

工银瑞信瑞丰定期开放纯债债券型发起式
证券投资基金
2019 年半年度报告摘要

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：中国光大银行股份有限公司

送出日期：二〇一九年八月二十八日

§1 重要提示

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 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 2019 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	工银瑞丰定开纯债债券发起式
基金主代码	002603
基金运作方式	契约型、定期开放式
基金合同生效日	2018 年 6 月 1 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	2,340,907,086.22 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的基础上，通过对固定收益类证券的积极投资，追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	<p>封闭期内，本基金将考察市场利率的动态变化及预期变化，对 GDP、CPI、PPI、外汇收支及国际市场流动性动态情况等引起利率变化的相关因素进行深入研究，分析国际与国内宏观经济运行的可能情景，并在此基础上判断包括财政政策以及国内和主要发达国家及地区的货币政策、汇率政策在内的宏观经济政策取向，对市场利率水平和收益率曲线未来的变化趋势做出预测和判断，结合债券市场资金及债券的供求结构及变化趋势，确定固定收益类资产的久期配置。在利率预期分析及其久期配置范围确定的基础上，通过情景分析和历史预测相结合的方法，“自上而下”在债券一级市场和二级市场，银行间市场和交易所市场，银行存款、信用债、政府债券等资产类别之间进行类属配置，进而确定具有最优风险收益特征的资产组合。</p> <p>开放期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种，减小基金净值的波动。</p>
业绩比较基准	中债综合财富（总值）指数。
风险收益特征	本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率低于股票型及混合型基金，高于货币市场基金。

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	石立平
	联系电话	400-811-9999	010-63639180
	电子邮箱	customerservice@icbccs.com.cn	shiliping@cebbank.com
客户服务电话		400-811-9999	95595
传真		010-66583158	010-63639132

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(2019年1月1日 - 2019年6月30日)
本期已实现收益	154,370,022.58
本期利润	103,813,219.56
加权平均基金份额本期利润	0.0261
本期基金份额净值增长率	2.46%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.0169
期末基金资产净值	2,597,869,359.51
期末基金份额净值	1.1098

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、本基金转型后基金合同生效日为 2018 年 6 月 1 日。

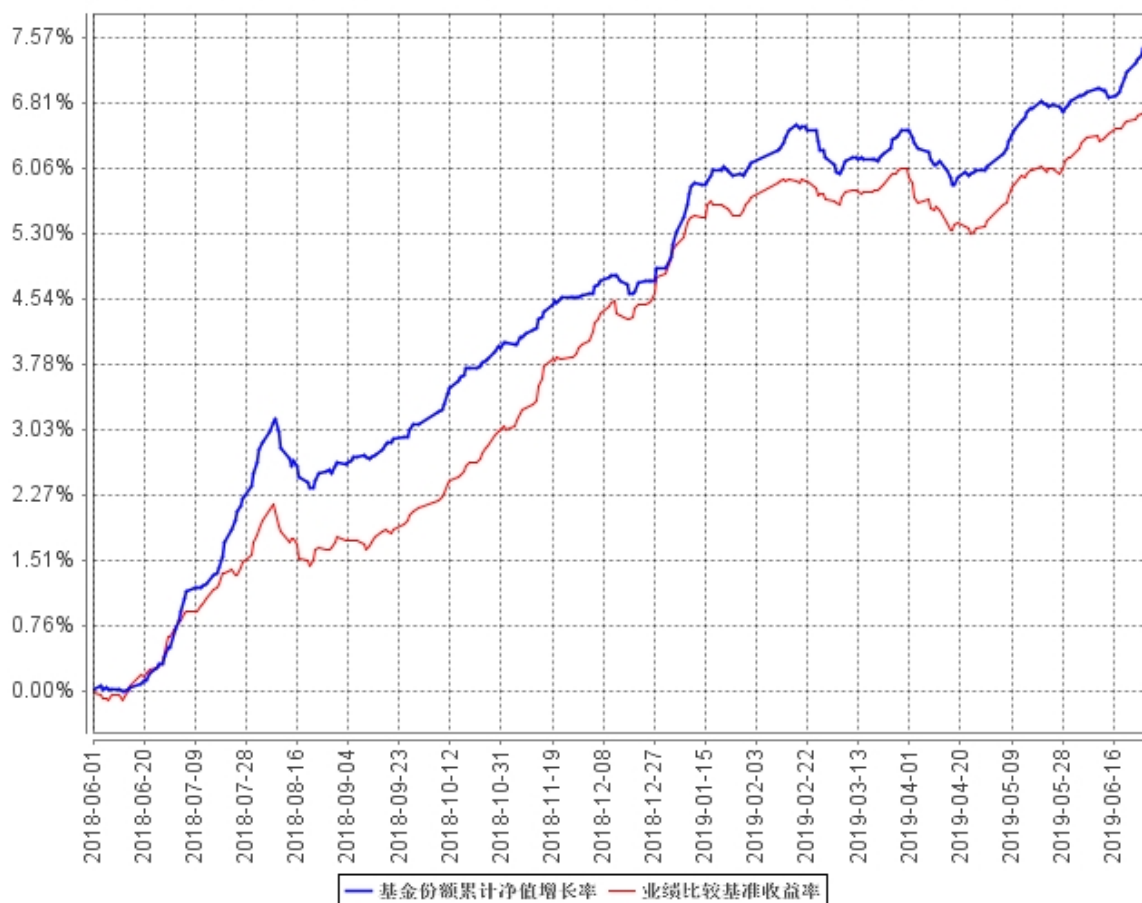
3.2 基金净值表现

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	0.60%	0.04%	0.53%	0.03%	0.07%	0.01%
过去三个月	0.91%	0.05%	0.65%	0.06%	0.26%	-0.01%
过去六个月	2.46%	0.06%	1.82%	0.06%	0.64%	0.00%
过去一年	6.92%	0.06%	6.08%	0.06%	0.84%	0.00%
自基金转型以来	7.46%	0.06%	6.74%	0.06%	0.72%	0.00%

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

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、本基金于 2018 年 6 月 1 日由“工银瑞信瑞丰纯债半年定期开放债券型证券投资基金”转型而来。

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：债券资产占基金资产的比例不低于 80%，但在每次开放期前 15 天、开放期及开放期结束后 15 天的期间内，基金投资不受上述比例限制；开放期内，每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金所持有现金及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%；在非开放期，本基金不受该比例的限制，但每个交易日日终在扣除国债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。

§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		
李娜	本基金的基金经理	2018 年 6 月 1 日	-	11	曾在中国工商银行总行担任交易员。2016 年加入工银瑞信，现任固定收益部基金经理。2017 年 1 月 24 日至 2018 年 3 月

				<p>20 日，担任工银瑞信恒丰纯债债券型证券投资基金基金经理；2017 年 1 月 24 日至 2018 年 5 月 3 日，担任工银瑞信恒泰纯债债券型证券投资基金基金经理；2017 年 4 月 14 日至今，担任工银瑞信瑞丰纯债半年定期开放债券型证券投资基金（自 2018 年 6 月 1 日起，变更为工银瑞信瑞丰定期开放纯债债券型发起式证券投资基金）基金经理；2017 年 5 月 27 日至今，担任工银瑞信纯债定期开放债券型证券投资基金基金经理；2017 年 5 月 27 日至今，担任工银瑞信目标收益一年定期开放债券型投资基金基金经理；2017 年 6 月 8 日至 2019 年 5 月 23 日，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；2017 年 6 月 27 日至今，担任工银瑞信丰实三年定期开放债券型证券投资基金基金经理，2018 年 6 月 7 日至今，担任工银瑞信瑞景定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理；2018 年 6 月 11 日至今，担任工银瑞信瑞祥定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理；2018 年 11 月 7 日至今，担任工银瑞信瑞福纯债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

海外方面，上半年发达国家经济延续放缓态势，美联储相应暂停了始于 2015 年末的持续加息进程，尤其 6 月以来市场降息预期明显升温，美元指数整体震荡，人民币汇率前期贬值压力缓和，后期由于国内基本面有所走弱、贸易摩擦加剧，贬值压力阶段性上升。国内方面，经济在一季度短暂企稳后、二季度下行压力再度加大，主要由于逆周期政策回撤以及贸易摩擦再度升级，

上半年地产投资增速高位提升，基建投资继续回升但较为温和，而制造业投资大幅下滑，消费增速偏弱，出口增速受累于海外经济放缓和贸易摩擦、也有所回落，工业生产略有放缓。流动性方面，得益于央行货币政策整体宽松，资金面维持宽松，6 月以来宽松态势加剧，资金利率位于历史极低位置。债券市场方面，一季度受流动性充裕带动，债券收益率在震荡中小幅下行，二季度则在 4 月货币政策边际调整，5 月贸易摩擦加剧压制市场风险偏好，6 月流动性宽松加剧中走出先上后下的行情，上半年收益率基本持平，10 年期国债收益率较去年末下行 0.1bp、10 年期国开收益率下行 3.2bp，信用利差整体收窄、中低等级中短期限品种信用利差的压缩较为顺畅，而长期限低等级债券信用利差仍处于较高分位数。

工银瑞丰定开纯债债券发起式基金在报告期内以杠杆策略为主，久期维持在 3 年左右，同时增加高票息信用债券持仓，进入新的封闭期后，适度拉长久期增加杠杆，并提高组合的静态收益率。

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 2.46%，业绩比较基准收益率为 1.82%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

往后看，G20 峰会缓解了之前贸易摩擦的紧张形势，短期内有利于风险偏好的提升，但总体来看，外围经济面临较大的下行压力，欧洲即使在负利率的情况下也还存在英国脱欧不确定性带来的负面影响，短时间内经济回升的概率极低；美国近期经济数据已呈现疲态，市场对于美联储年内降息的预期也达成一致，预计经济大概率也将下行，即使贸易条件有所好转，预计出口对国内经济依然是负面影响。同时房地产后周期需求难以回升，房地产抬升的居民杠杆以及经济活动疲弱使得居民的可支配收入下降；企业对经济的悲观使得生产经营趋弱，而包商事件对于信用传导机制的破坏使得流动性分层，低等级企业再融资的压力加大并且这一影响将会持续，势必会对社融形成拖累。近两年政府对经济数字的容忍度已经有所提升，政策上也更着力于调结构，因此预计逆周期调节的政策将会延续，强刺激的政策难以再现，预计国内经济仍将处于缓慢下行通道，中期来看，债券收益率仍将在底部震荡。

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，本基金实施利润分配的金额为 250,500,654.20 元，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瑞丰定期开放纯债债券型发起式证券投资基金（以下称“本基金”）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，对本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编制的《工银瑞信瑞丰定期开放纯债债券型发起式证券投资基金 2019 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（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、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：工银瑞信瑞丰定期开放纯债债券型发起式证券投资基金

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
资产：			
银行存款		2,387,763.38	34,860,747.92
结算备付金		32,173,070.45	25,054,715.21
存出保证金		153,683.53	3,834.90
交易性金融资产		3,853,782,400.00	6,571,110,200.00
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		3,715,839,400.00	6,336,098,200.00
资产支持证券投资		137,943,000.00	235,012,000.00
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	200,017,500.03
应收证券清算款		-	-
应收利息		71,155,091.89	108,563,287.94
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		155.33	-
资产总计		3,959,652,164.58	6,939,610,286.00
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 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		1,359,198,183.20	2,202,057,916.91
应付证券清算款		-	238,436.19
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		866,780.25	1,203,856.22
应付托管费		288,926.74	401,285.42
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		70,737.59	57,246.00

应交税费		572,261.06	592,212.61
应付利息		675,391.14	2,576,891.84
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		110,525.09	394,300.00
负债合计		1,361,782,805.07	2,207,522,145.19
所有者权益：			
实收基金		2,340,907,086.22	4,140,394,761.85
未分配利润		256,962,273.29	591,693,378.96
所有者权益合计		2,597,869,359.51	4,732,088,140.81
负债和所有者权益总计		3,959,652,164.58	6,939,610,286.00

注：1、本基金基金合同生效日为 2018 年 6 月 1 日。

2、报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值为人民币 1.1098 元，基金份额总额为 2,340,907,086.22 份。

6.2 利润表

会计主体：工银瑞信瑞丰定期开放纯债债券型发起式证券投资基金

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 6 月 1 日(基 金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日
一、收入		141,024,888.07	27,957,989.81
1.利息收入		130,191,610.77	23,865,245.58
其中：存款利息收入		577,166.49	10,828.89
债券利息收入		124,890,879.71	23,438,103.18
资产支持证券利息收入		4,575,256.47	416,313.51
买入返售金融资产收入		148,308.10	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		61,390,078.21	-341.37
其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益		61,482,107.80	-
资产支持证券投资收益		-92,029.59	-341.37
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-50,556,803.02	4,093,085.60

4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）		2.11	-
减：二、费用		37,211,668.51	5,122,422.90
1. 管理人报酬		6,679,829.59	1,113,716.01
2. 托管费		2,226,609.85	371,238.70
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		43,047.13	26,640.00
5. 利息支出		27,700,198.77	3,501,383.99
其中：卖出回购金融资产支出		27,700,198.77	3,501,383.99
6. 税金及附加		435,225.30	77,430.80
7. 其他费用		126,757.87	32,013.40
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		103,813,219.56	22,835,566.91
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		103,813,219.56	22,835,566.91

注：本基金基金合同生效日为 2018 年 6 月 1 日。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：工银瑞信瑞丰定期开放纯债债券型发起式证券投资基金

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）	4,140,394,761.85	591,693,378.96	4,732,088,140.81
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	103,813,219.56	103,813,219.56
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）	-1,799,487,675.63	-188,043,671.03	-1,987,531,346.66
其中：1. 基金申购款	524,758.96	57,625.41	582,384.37
2. 基金赎回款	-1,800,012,434.59	-188,101,296.44	-1,988,113,731.03

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）	-	-250,500,654.20	-250,500,654.20
五、期末所有者权益（基金净值）	2,340,907,086.22	256,962,273.29	2,597,869,359.51
项目	上年度可比期间 2018年6月1日(基金合同生效日)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）	4,140,516,066.92	371,404,203.64	4,511,920,270.56
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	22,835,566.91	22,835,566.91
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）	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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）	4,140,516,066.92	394,239,770.55	4,534,755,837.47

注：本基金基金合同生效日为2018年6月1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	赵紫英	关亚君
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

工银瑞信瑞丰定期开放纯债债券型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)是由原工银瑞信瑞丰纯债半年定期开放债券型证券投资基金转型而来。根据基金管理人工银瑞信基金管理有限公司于2018年5月4日发布的《工银瑞信基金管理有限公司关于工银瑞信瑞丰纯债半年定期

开放债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，原工银瑞信瑞丰纯债半年定期开放债券型证券投资基金于自 2018 年 4 月 3 日起至 2018 年 5 月 2 日期间以通讯方式召开了基金份额持有人大会。依据此次基金份额持有人大会决议，本基金《工银瑞信瑞丰定期开放纯债债券型发起式证券投资基金基金合同》自 2018 年 6 月 1 日起生效。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《工银瑞信瑞丰定期开放纯债债券型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、次级债、政府支持机构债券、证券公司短期公司债券、可转换债券（含可分离交易可转债的纯债部分）、可交换债券、资产支持证券、银行存款、同业存单、债券回购等固定收益类金融工具以及国债期货，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。本基金不投资于股票、权证等权益类资产，但可持有因可转换债券转股所形成的股票或可分离交易可转债分离交易的权证等资产。因上述原因持有的股票和权证等资产，在其可上市交易后不超过 10 个交易日的时间内卖出。本基金投资组合资产配置比例：债券资产占基金资产的比例不低于 80%，但在每次开放期前 15 天、开放期及开放期结束后 15 天的期间内，基金投资不受上述比例限制；开放期内，每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金所持有现金及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%；在非开放期，本基金不受该比例的限制，但每个交易日日终在扣除国债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；其中，现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。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，其投资比例遵循届时有效法律法规或相关规定。本基金的业绩比较基准为中债综合财富（总值）指数收益率。

本基金为发起式基金，发起资金认购部分为 9,175,078.00 份基金份额，发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于 3 年。

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—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》、《工银瑞信瑞丰定期开放纯债债券型发起式证券投资基金基金合同》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 年上半年度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

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

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

无。

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 2019年1月1日至2019年6 月30日	上年度可比期间 2018年6月1日(基金合同生效日)至 2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	6,679,829.59	1,113,716.01
其中：支付销售机构的客户维护费	3,329,703.15	561,517.54

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.30% 的年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

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

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

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6月1日(基金合同生效日) 至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,226,609.85	371,238.70

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

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

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

单位：人民币元

上年度可比期间 2018 年 6 月 1 日(基金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日						
银行间市场交 易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金 额	利息收 入	交易金额	利息支出
中国光大银行 股份有限公司	-	-	-	-	5,066,110,000.00	965,660.37

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**

份额单位：份

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 6 月 1 日(基金合同生效 日)至 2018 年 6 月 30 日
基金合同生效日（2018 年 6 月 1 日）持有的基金份额	-	9,175,078.00
期初持有的基金份额	9,175,078.00	-
期间申购/买入总份额	506,062.07	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	9,681,140.07	9,175,078.00
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.41%	0.22%

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。

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

份额单位：份

关联 方名 称	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日

	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
中国光大银行股份有限公司	2,329,576,030.10	99.52%	4,129,576,030.10	99.74%

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

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6月1日(基金合同生效日)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
中国光大银行股份有限公司	2,387,763.38	270,837.87	6,481,719.31	4,296.46

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（2019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

无。

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

截至本报告期末 2019 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 731,198,183.20 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
101561009	15 中电投 MTN002	2019 年 7 月 3 日	101.85	10,000	1,018,500.00
101651058	16 渝水务 MTN001	2019 年 7 月 3 日	100.34	400,000	40,136,000.00
101752033	17 津城建 MTN003	2019 年 7 月 3 日	101.98	400,000	40,792,000.00
101800858	18 文广集团 MTN001	2019 年 7 月 3 日	101.19	400,000	40,476,000.00
101800429	18 京国资 MTN001	2019 年 7 月 3 日	102.28	400,000	40,912,000.00
101800729	18 京能电力 MTN001	2019 年 7 月 1 日	102.63	500,000	51,315,000.00
101800682	18 川发展 MTN001	2019 年 7 月 2 日	102.59	750,000	76,942,500.00
101560022	15 闽高速 MTN002	2019 年 7 月 1 日	104.17	800,000	83,336,000.00
101754097	17 津城建 MTN002	2019 年 7 月 1 日	101.83	1,000,000	101,830,000.00
101759002	17 川发展 MTN001	2019 年 7 月 2 日	103.90	1,300,000	135,070,000.00
101751034	17 鲁高速 MTN003	2019 年 7 月 3 日	104.30	1,500,000	156,450,000.00
合计				7,460,000	768,278,000.00

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 6 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 628,000,000.00 元，于 2019 年 7 月 2 日,7 月 3 日,7 月 4 日先后到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,853,782,400.00	97.33
	其中：债券	3,715,839,400.00	93.84
	资产支持证券	137,943,000.00	3.48
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	34,560,833.83	0.87
8	其他各项资产	71,308,930.75	1.80
9	合计	3,959,652,164.58	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

本基金本报告期末未持有境内股票投资。

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

本基金本报告期末未持有股票投资。

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

本基金本报告期无买入股票明细。

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

本基金本报告期无卖出股票明细。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期无买入卖出股票交易。

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	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	1,063,813,000.00	40.95
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	2,652,026,400.00	102.08
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,715,839,400.00	143.03

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	155185	19 南航 01	2,300,000	228,988,000.00	8.81
2	101759008	17 金融街 MTN001A	1,900,000	192,432,000.00	7.41
3	101751034	17 鲁高速	1,500,000	156,450,000.00	6.02

		MTN003			
4	101759002	17 川发展 MTN001	1,300,000	135,070,000.00	5.20
5	101751026	17 天津轨交 MTN001	1,000,000	102,000,000.00	3.93

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序前十名资产支持证券投资明细

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量 (份)	公允价值	占基金资产净值 比例(%)
1	1889091	18 建元 9A3_bc	600,000	58,266,000.00	2.24
2	1889109	18 飞驰建 融 2A	1,000,000	53,630,000.00	2.06
3	1889049	18 飞驰建 融 1A	700,000	26,047,000.00	1.00

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国债期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.10.2 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。

7.10.3 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。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 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

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。

7.11.2 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超出基金合同规定的备选股票库情况的说明。

7.11.3 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	153,683.53
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	71,155,091.89
5	应收申购款	-
6	其他应收款	155.33
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	71,308,930.75

7.11.4 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。

7.11.5 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
156	15,005,814.66	2,339,257,170.17	99.93%	1,649,916.05	0.07%

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 持有本基金	37,742.38	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	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

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占 基金总份 额比例（%）	发起份额总数	发起份额占 基金总份 额比例（%）	发起份额承 诺持有期限
基金管理人固有资 金	9,681,140.07	0.41	9,175,078.00	0.39	3年
基金管理人高级管 理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	9,681,140.07	0.41	9,175,078.00	0.39	3年

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2018年6月1日）基金份额总额	4,140,516,066.92
本报告期期初基金份额总额	4,140,394,761.85
本报告期期间基金总申购份额	524,758.96
减：本报告期期间基金总赎回份额	1,800,012,434.59
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	2,340,907,086.22

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

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未受到稽查或处罚。

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	
光大证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	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
光大证券	1,186,081,939.98	91.06%	34,090,600,000.00	85.35%	-	-
东方证券	116,464,706.44	8.94%	5,851,195,000.00	14.65%	-	-

§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**

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	20190101-20190630	4,129,576,030.10	-	1,800,000,000.00	2,329,576,030.10	99.52%
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。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。