工银瑞信货币市场基金

2014 第一季度 报告

2014年3月31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
报告送出日期:二〇一四年四月二十一日

§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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年4月16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2014年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	工银货币
交易代码	482002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年3月20日
报告期末基金份额总额	66,498,843,289.49份
投资目标	力求保证基金资产安全和良好流动性的前提下,获得超过业绩比较基准的收益。
投资策略	在确定的利率策略和期限结构、类属配置策略下,通过短期货币市场工具的投资来获取稳定的收益。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为税后6个月银行定期储蓄存款利率,即(1-利息税率)×6个月银行定期储蓄存款利率
风险收益特征	本基金为货币市场基金,在所有证券投资基金中,是风险相对较低的基金产品。在一般情况下,其风险与预期收益均低于一般债券基金,也低于混合型基金与股票型基金
基金管理人	工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§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(2014年1月1日-2014年3月31日)
1. 本期已实现收益	706,287,543.34
2.本期利润	706,287,543.34
3.期末基金资产净值	66,498,843,289.49

注:(1)本基金收益分配是按日结转份额。

(2)所列数据截止到2014年3月31日。

(3)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。

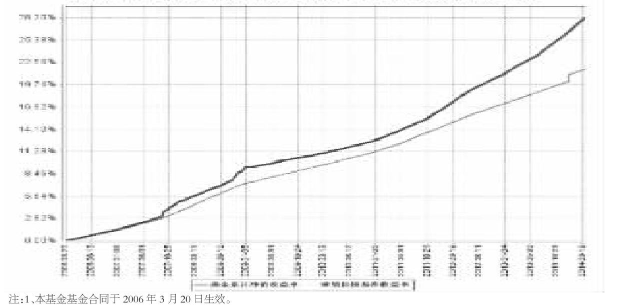
(4)本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	1.3814%	0.0011%	0.6904%	0.0000%	0.6910%	0.0011%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1、本基金基金合同于2006年3月20日生效。

2、按基金合同规定,本基金自基金合同生效起三个月内为建仓期,截至报告期末,本基金的各项投资比例符合基金合同关于投资范围、投资组合限制与禁止行为的规定:本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日不得超过180天;本基金投资于同一公司发行的短期企业债券的比例,不得超过基金资产净值的10%;除发生巨额赎回的情形外,本基金的投资组合中,债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的20%。

§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		
魏欣	本基金的基金经理	2011年4月20日	-	9	2005年加入工银瑞信,曾任债券交易员、固定收益研究员;2011年4月20日起至今担任工银货币市场基金基金经理;2012年8月22日起至今担任工银瑞信7天理财债券型基金基金经理;2012年10月26日起至今担任工银瑞信14天理财债券型发起式基金的基金经理。
杜海涛	固定收益投资总监,本基金的基金经理。	2013年1月7日	-	17	先后在宝盈基金管理有限公司担任基金经理助理,招商基金管理有限公司担任招商现金增值基金基金经理; 2006年加入工银瑞信,现任固定收益投资总监;2006年9月21日至2011年4月21日,担任工银货币市场基金基金经理;2010年8月16日至2012年1月10日,担任工银双利债券型基金基金经理;2007年5月11日至今,担任工银增强收益债券型基金基金经理;2011年8月10日至今,担任工银瑞信添颐债券型证券投资基金基金经理;2012年6月21日至今,担任工银纯债定期开放基金基金经理;2013年1月7日至今,担任工银货币基金基金经理;2013年8月14日至今,担任工银月月薪定期支付债券型基金基金经理;2013年10月31日至今,担任工银添福债券基金基金经理;2014年1月27日至今,担任工银薪金货币市场基金基金经理。
王朔	本基金的基金经理	2013年11月11日	-	4	2010年加入工银瑞信,曾任研究部研究员、固定收益部研究员。2013年11月11日至今,担任工银货币市场基金基金经理;2014年1月27日至今,担任工银薪金货币市场基金基金经理。

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 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;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业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

一季度经济增长持续回落。去年下半年央行偏紧的货币政策,以及房地产和地方政府对有限资金的争夺抬高了社会整体的融资利率,对当前实体经济造成了较明显的打击。同时,伴随着房地产销售的下行,房价和房地产投资增速也开始下降,整体需求的下滑进一步带动了企业去库存。虽然外需复苏温和,但对于国内出口带动力有限。整体经济增长的疲弱也使得通胀水平维持低位。

市场表现来看,一方面由于季节性因素的存在,另一方面也是整体资金需求较为疲弱,一季度资金价格逐步宽松,债券收益率出现了明显下行。1年期国债收益率从4.22%下行至3.09%;1年期国开债收益率从5.49%下行至4.84%;1年期AAA短融收益率从6.27%下行至5.21%。

一季度,本基金通过对客户需求和货币市场情况的判断,合理安排组合现金流,保证了充足的流动性。由于判断春节前资金价格仍维持高位,因此基金保持了相对较高的存款配置比例;同时在春节之后适当增加了债券的配置比例,在控制流动性风险的情况下,保持组合较高的收益水平。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金净值收益率为1.3814%,业绩比较基准收益率为0.6904%。

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2014年二季度,宏观经济增长存在进一步回落的可能。一方面根据流动性对经济增长的领先性,前期流动性增速的放缓意味着后期经济增长的疲弱;另一方面,今年地方政府考核方式发生了变化,淡化GDP而强化债务约束和环境保护,以往基建投资拉动经济增长的效果将会被削弱。经济增长的进一步回落,会使得通胀水平进一步趋弱。在这种宏观背景下,叠加融资需求的下降和去年高基数的影响,M2增速大概率在央行目标之内,货币政策没有明显收紧的空间。货币市场利率水平中枢有望维持低位。协议存款收益率曲线会继续出现陡峭化下行,而短融收益率也存在进一步下行空间。

本基金在二季度将保持适度的久期水平,严格限制低评级短期融资券持仓,重点在月末季末把握好存款的投资机会,并适当增加短期债券的配置比例。在保证组合安全性的前提下,获取稳定、合理的收益一直是我们进行现金类资产管理所追求的目标。

§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	固定收益投资	15,291,904,870.22	21.21
	其中:债券	15,291,904,870.22	21.21
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	55,777,494,584.37	77.35
4	其他资产	1,040,715,146.98	1.44
5	合计	72,110,114,601.57	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 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额		5.76
	其中:买断式回购融资		0.06
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	5,550,740,685.11	8.35
	其中:买断式回购融资	-	-

注:报告期内债券融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产余额比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过基金资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	109
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	159
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	84

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

本报告期内无投资组合平均剩余期限超过180天情况。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	9.68	8.35
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	33.31	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	26.17	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-180天	20.94	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	16.83	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	106.92	8.35

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	摊余成本(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	4,233,193,539.22	6.37
	其中:政策性金融债	4,233,193,539.22	6.37
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	11,058,711,331.00	16.63
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	15,291,904,870.22	23.00
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

注:上表中,债券的成本包括债券面值和折溢价。

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	140204	14国开04	20,000,000	2,002,283,832.66	3.01
2	011422001	14神华SCP001	6,000,000	599,437,171.71	0.90
3	140319	14进出19	6,000,000	587,005,986.41	0.88
4	130236	13国开36	4,000,000	399,618,551.11	0.60
5	120409	12农发09	4,000,000	399,508,938.69	0.60
6	041351044	13华谊CP001	3,500,000	349,595,603.04	0.53
7	041455005	14陕煤化CP001	3,000,000	300,000,268.66	0.45
8	011424001	14中冶SCP001	3,000,000	299,888,928.70	0.45
9	011467001	14神华能源SCP001	3,000,000	299,593,744.52	0.45
10	140316	14进出16	3,000,000	294,070,582.82	0.44

注:上表中,债券的成本包括债券面值和折溢价。

5.6 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	-
报告期内偏离度的最高值	0.0609%
报告期内偏离度的最低值	-0.1133%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0400%

注:上表中"偏离情况"根据报告期内各工作日数据计算。

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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 本基金采用固定份额净值,基金账面份额净值始终保持为人民币1.00元。本基金估值采用摊余成本法,即估值对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内按实际利率法进行摊销,每日计提收益或损失。

5.8.2 本报告期内,本基金持有的剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本总计在每个交易日均未超过日基金资产净值20%。

5.8.3 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。

5.8.4 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	30,670,023.29
3	应收利息	747,249,451.08
4	应收申购款	262,371,550.15
5	其他应收款	424,122.46
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	1,040,715,146.98

5.8.5 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

报告期期初基金份额总额	24,282,562,454.23
报告期期间基金总申购份额	140,654,928,001.26
减:报告期期间基金总赎回份额	98,438,647,166.00
报告期期末基金份额总额	66,498,843,289.49

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

本基金管理人本报告期内运用固有资金投资本基金情况未有变化。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

本基金托管人2014年2月7日发布任免通知,解聘尹东中国建设银行投资托管业务部总经理助理职务。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准工银瑞信货币市场基金设立的文件;
2、《工银瑞信货币市场基金基金合同》;
3、《工银瑞信货币市场基金托管协议》;
4、基金管理人业务资格批件和营业执照;
5、基金托管人业务资格批件和营业执照;
6、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

9.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

9.3 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,可在合理时间内取得上述文件的复印件。

工银瑞信主题策略股票型证券投资基金

2014 第一季度 报告

2014年3月31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:二〇一四年四月二十一日

§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2014年4月16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2014年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	工银主题策略股票
交易代码	481015
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年10月24日
报告期末基金份额总额	77,420,182.15份
投资目标	结合宏观经济转型方向,通过分析社会经济热点动向,把握相关主题投资机会,追求基金资产长期稳定的增值和收益,在控制投资风险的同时,力争持续实现超越业绩基准的收益。
投资策略	类别资产配置上,本基金运用国际化的视野审视中国经济和资本市场,依据定量和定性相结合的方法,考虑经济情景、类别资产收益风险预期等因素,在股票与债券等资产类别之间进行资产配置;在股票投资方面,本基金主要采取主题投资策略,在宏观经济发展的不同阶段,关注经济发展热点,深入挖掘潜在的主题投资机会,寻找实质受益的上市公司,并综合考虑其基本面情况,选择具备投资价值的股票,构建投资组合,并不断优化组合,争取获得超越业绩基准的收益水平。本基金还将在法规允许的范围内,基于谨慎原则利用权证以及其它金融工具进行套利交易或风险管理,为基金收益提供增加价值。
业绩比较基准	80%×沪深300指数收益率+20%×中债综合指数收益率
风险收益特征	本基金是股票型基金,其预期收益及风险水平高于债券型基金、混合型基金和货币市场基金,属于风险水平较高的基金。
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

§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(2014年1月1日-2014年3月31日)
1.本期已实现收益	4,320,497.66
2.本期利润	-1,757,280.75
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0231
4.期末基金资产净值	96,854,257.60
5.期末基金份额净值	1.251

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"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。

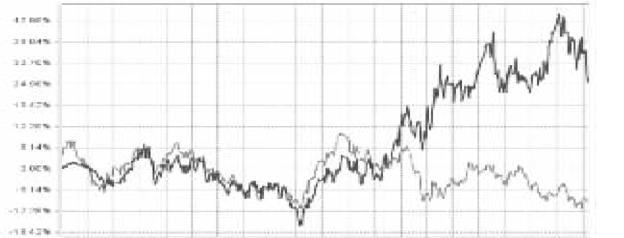
(3)所列数据截止到2014年3月31日。

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

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	-1.57%	1.74%	-5.84%	0.95%	4.27%	0.79%

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



注:1、本基金基金合同于2011年10月24日生效。

2、按基金合同规定,本基金建仓期为6个月。截至报告期末,本基金的投资符合基金合同的相关规定:本基金股票资产占基金资产的比例为60%-95%,债券、现金等金融工具及其他资产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%。

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		
黄安乐	本基金的基金经理	2011年11月23日	-	11	先后在天相投资顾问有限公司担任研究员,国信证券经济研究所担任资深分析师,国信证券资产管理总部担任投资经理、研究员; 2010年加入工银瑞信,曾任高级研究员兼专户投资顾问,2011年11月23日至今担任工银主题策略股票基金基金经理,2013年9月23日至今担任工银瑞信精选平衡基金基金经理。
曹冠业	权益投资部总监,本基金的基金经理。	2011年10月24日	-	13	CFA、FRM;先后在东方汇理担任结构基金和亚太股票基金经理,香港恒生投资管理公司担任香港中国股票和QFII基金投资经理; 2007年加入工银瑞信,现任权益投资部总监,兼任工银瑞信资产管理(国际)有限公司权益投资总监;2007年11月29日至2009年5月17日,担任工银核心价值基金基金经理;2008年2月14日至2009年12月25日,担任工银全球基金基金经理;2009年5月18日至今,担任工银成长基金基金经理;2011年10月24日至今,担任工银主题策略股票基金基金经理;2013年9月23日至今担任工银瑞信中国机会全球配置基金基金经理;2013年11月11日至今担任工银瑞信信息产业股票型基金基金经理。

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 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;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业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2014年1季度,A股市场跌宕起伏,1月份创业板和中小板指数大幅度上涨,各类主题概念板块精彩纷呈,而大盘蓝筹类股票表现低迷;进入2、3月份,主题概念板块回落,而银行地产等低估值板块有所上涨。整个1季度下来,成长股退潮,价值股有所抬头。

本季度内,工银主题策略基金的配置主要集中在节能环保、医疗服务、国防军工、新能源汽车及其产业链、信息安全、北斗产业链及新一代信息技术等几个主要领域上,原因在于我们看淡中国宏观经济的前景以及与经济总量密切相关的传统行业,而将资产配置到了与转型相关的新兴产业之上。因为配置上的这种偏向,导致1月份业绩表现较好,而2、3月份回落也较多。从中长线来看,我们仍看好上述几个领域的投资机会,因此,短期内我们会规避系统性的风险而降低整体的股票仓位,但配置的方向不作改变。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金净值增长率为-1.57%,业绩比较基准收益率为-5.84%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为,我国宏观经济增长速度下一个台阶是大势所趋,产业的升级和结构的调整是势在必行的事情。反映到证券市场,与经济增长密切相关的传统产业,如果没有动力改变,则面临收入利润下滑的压力;而代表产业升级和结构转型的新兴产业,经过2013年和今年年初的大幅度上涨之后,需要业绩的确认以形成估值的匹配,同时股票供给压力的存在也决定这些集中于创业板和中小板的股票有调整和休整的需要。

因此,我们认为,从中长线看观察,代表产业升级和结构转型的新兴产业,仍是未来的投资主战场;短期而言,则应该重视整体市场的系统性风险,可以考虑降低仓位进行防御;另外,在新兴产业中,虽然行业配置的方向不变,但是,因为估值和业绩的匹配问题,我们预计会出现比较大的个股分化,因此,在个股的选择上,要求更加严苛,宁缺毋滥是个基本的原则。

§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	77,487,868.82	79.09
	其中:股票	77,487,868.82	79.09
2	固定收益投资	4,997,000.00	5.10
	其中:债券	4,997,000.00	5.10
	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	-	-
	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	6,599,780.40	6.74
7	其他资产	8,894,158.10	9.08
8	合计	97,978,807.32	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

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	1,889,550.00	1.95
C	制造业	53,618,139.49	55.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	1,642,800.00	1.70
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	16,757,179.33	17.30
J	金融业	-	-
K	房地产业	1,974,600.00	2.04
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,605,600.00	1.66
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	77,487,868.82	80.00

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。

5.3 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	300113	顺网科技	100,073	5,124,738.33	5.29
2	300086	康芝药业	300,097	4,573,478.28	4.72
3	300137	先河环保	200,000	4,196,000.00	4.33
4	002475	立讯精密	110,000	3,955,600.00	4.08
5	600776	东方通信	330,000	3,795,000.00	3.92
6	300016	北陆药业	400,000	3,780,000.00	3.90
7	300257	开山股份	101,671	3,447,663.61	3.56
8	603000	人民网	45,000	3,150,000.00	3.25
9	600835	上海机电	150,000	2,886,000.00	2.98
10	300213	佳讯飞鸿	95,000	2,365,500.00	2.44

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	4,997,000.00	5.16
	其中:政策性金融债	4,997,000.00	5.16
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	4,997,000.00	5.16

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	130418	13农发18	50,000	4,997,000.00	5.16

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

本基金本报告期末未持有股指期货投资,也无期间损益。

5.9.2 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。

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 投资组合报告附注

5.11.1 本基金基金投资前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的投资决策程序说明:

根据康芝药业2013年3月19日披露的《关于公司2011年半年度及2011年第三季度财务信息更正的公告》显示,公司2011年半年报告及2011年第三季度报告存在重大会计差错。更正后,2011年半年度报告归属于母公司股东的净利润减少了953.85万元,与更正前相比下降了43.10%;2011年第三季度报告归属于母公司股东的净利润减少530.51万元,与更正前相比下降了36.99%。

上述行为违反了深圳证券交易所《创业板股票上市规则(2012年修订)》第2.1条的相关规定。康芝药业董事长兼总裁洪江游、董事兼副总裁洪江涛、时任董事会秘书李幽泉、财务总监刘会良未能恪尽职守、履行诚信勤勉义务,给与公开批评处分。

上述事项对公司的生产经营活动基本无影响。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	62,237.92
2	应收证券清算款	8,399,086.75
3	应收股利	-
4	应收利息	131,823.46
5	应收申购款	301,009.97
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,894,158.10

5.11.4 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。

5.11.5 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	300213	佳讯飞鸿	2,365,500.00	2.44	重大事项

5.11.6 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

报告期期初基金份额总额	77,211,431.44
报告期期间基金总申购份额	16,329,947.72
减:报告期期间基金总赎回份额	16,121,197.01
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	77,420,182.15

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本基金管理人本报告期内运用固有资金投资本基金情况未有变化。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准工银瑞信主题策略股票型证券投资基金设立的文件;
2、《工银瑞信主题策略股票型证券投资基金基金合同》;
3、《工银瑞信主题策略股票型证券投资基金托管协议》;
4、基金管理人业务资格批件和营业执照;
5、基金托管人业务资格批件和营业执照;
6、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

9.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的办公场所。

9.3 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。

工银瑞信添颐债券型证券投资基金

2014 第一季度 报告

2014年3月31日

基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人:中国民生银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一四年四月二十一日

§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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年4月16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2014年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	工银添颐债券	
交易代码	485114	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2011年8月10日	
报告期末基金份额总额	452,368,242.59份	
投资目标	在保持基金资产流动性与控制基金风险的前提下,力争实现超越业绩比较基准的长期投资回报,为投资者提供养老投资的工具。	
投资策略	本基金将在资产配置策略的基础上,通过固定收益类品种投资策略构筑债券组合的平稳收益,通过积极的权益类资产投资策略追求基金资产的增强型回报。	
业绩比较基准	五年期定期存款利率+1.5%	
风险收益特征	本基金为债券型基金,预期收益和风险水平高于货币市场基金,低于混合型基金与股票型基金;因为本基金可以配置二级市场股票,所以预期收益和风险水平高于投资范围不含二级市场股票的债券型基金。	
基金管理人	工银瑞信基金管理有限公司	
基金托管人	中国民生银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	工银添颐债券A	工银添颐债券B
下属两级基金的交易代码	485114	485014
报告期末下属两级基金的份额总额	168,398,240.76份	283,970,001.83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(2014年1月1日-2014年3月31日)	
	工银添颐债券A	工银添颐债券B
1.本期已实现收益	-3,354,008.50	-5,523,920.54
2.本期利润	1,398,477.22	1,430,073.00
3.加权平均基金份额本期利润	0.0075	0.0048
4.期末基金资产净值	208,729,295.24	345,506,856.56
5.期末基金份额净值	1.239	1.217

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"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2014年3月31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

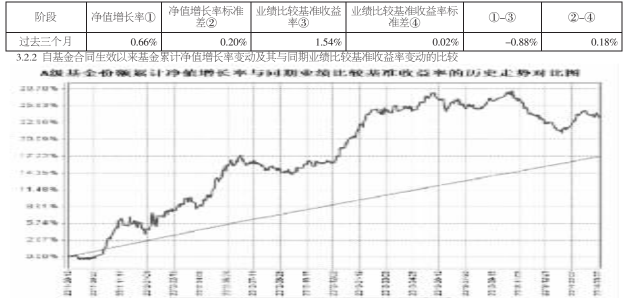
工银添颐债券A

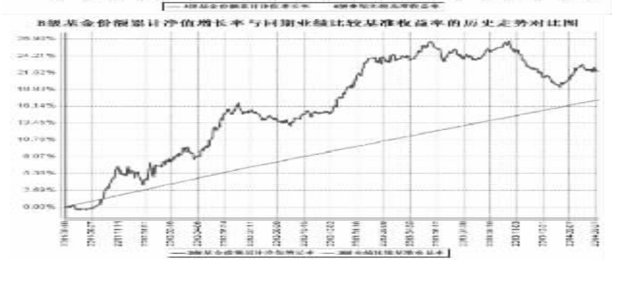
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.73%	0.20%	1.54%	0.02%	-0.81%	0.18%

工银添颐债券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	0.66%	0.20%	1.54%	0.02%	-0.88%	0.18%

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





注:1、本基金基金合同于2011年8月10日生效。

2、按基金合同规定,本基金建仓期为6个月。截至报告期末,本基金的投资符合基金合同的相关规定:本基金投资债券等固定收益类资产占基金资产的比例不低于80%;股票等权益类资产占基金资产的比例不超过20%,现金及到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于5%。

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		
杜海涛	固定收益投资总监,本基金的基金经理。	2011年8月10日	-	17	先后在宝盈基金管理有限公司担任基金经理助理,招商基金管理有限公司担任招商现金增值基金基金经理; 2006年加入工银瑞信,现任固定收益投资总监;2006年9月21日至2011年4月21日,担任工银货币市场基金基金经理;2010年8月16日至2012年1月10日,担任工银双利债券型基金基金经理;2007年5月11日至今,担任工银增强收益债券型基金基金经理;2011年8月10日至今,担任工银瑞信添颐债券型证券投资基金基金经理;2012年6月21日至今,担任工银纯债定期开放基金基金经理;2013年1月7日至今,担任工银货币基金基金经理;2013年8月14日至今,担任工银月月薪定期支付债券型基金基金经理;2013年10月31日至今,担任工银添福债券基金基金经理;2014年1月27日至今,担任工银薪金货币市场基金基金经理。
宋炳珅	本基金的基金经理,研究部总监	2012年2月14日	-	10	曾任中信建投证券有限公司研究员; 2007年加入工银瑞信,现任研究部总监。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日至今,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,担任工银红利基金基金经理;2014年1月20日至今,担任工银核心价值基金基金经理。

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 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;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业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

1季度经济增长持续回落,房地产周期下行引起的需求下滑带动企业持续去库存。虽然外需复苏温和,但对于国内出口带动力相对有限。通胀水平维持低位,有较大的下行压力。市场表现方面,虽然央行没有释放明确的放松信号,但在人民币持续贬值和外汇占款趋势下行的情况下,资金价格仍然较为宽松。这一方面是由于季节性因素的存在,另一方面也是整体资金需求较为疲弱的反映。在资金面宽松的背景下,无风险利率和风险溢价出现了明显下行,具体来看:

1-2月,回购利率回落,债券净发行保持低位,收益率曲线陡峭化下行。其中,政策性金融债好于国债,信用债好于利率债。3月开始,超日债违约导致风险偏好急剧下降,央行持续正回购促使资金面出现收紧,再加上债券供给明显加大,收益率出现了20-35BP左右的反弹。报告期内,尽管资金面较为宽松,但经济增长低于预期,流动性和盈利对股市的影响出现背离。在这种情况下,可转债和股市以结构性行情为主,整体无明显趋势。

工银添颐本报告期内根据宏观经济和通胀形势的变化,适时调整组合久期,进一步降低低资质债券的持仓比重和平均期限,可转债和股票方面以波段操作为主。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内,工银添颐A净值增长率0.73%,工银添颐B净值增长率0.66%,业绩比较基准收益率为1.54%。

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2014年2季度,宏观经济增长存在进一步回落的可能。一方面根据流动性对经济增长的领先性,前期流动性增速的放缓意味着后期经济增长的疲弱;另一方面,今年地方政府考核方式发生了变化,淡化GDP而强化债务约束和环境保护,以往基建投资拉动经济增长的效果将会被削弱。经济增长的进一步回落,会使得通胀水平进一步趋弱。在这种宏观背景下,叠加融资需求的下降和去年高基数的影响,M2增速大概率在央行目标之内,货币政策难以明显收紧,资金面将保持平稳。在回购利率稳定、套利利差偏高的情况下,债券收益率有进一步下行的空间。

随着宏观经济的持续回落,债券发行人的资质持续弱化,再加上2季度以后是信托和低评级债券的到期高峰,信用风险可能进一步加大,国债等利率债的相对价值更高;可转债和股市仍将呈现结构性行情。2014年2季度,本基金将适时调整久期,继续提高组合的信用资质,在可转债和股票方面努力做好波段操作与结构调整。

§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	75,808,442.45	7.92
	其中:股票	75,808,442.45	7.92
2	固定收益投资	845,300,699.54	88.35
	其中:债券	845,300,699.54	88.35
	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	-	-
	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	10,282,394.86	1.07
7	其他资产	25,392,645.45	2.65
8	合计	956,784,182.30	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

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	-	-
C	制造业	7,550,954.00	1.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,418,931.49	1.16
E	建筑业	2,807,277.00	0.51
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	2,664,593.55	0.48
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	36,144,879.93	6.52
K	房地产业	20,221,806.48	3.65
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	75,808,442.45	13.68

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。

5.3 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	000001	平安银行	1,295,609	13,953,708.93	2.52
2	600030	中信证券	803,400	8,459,802.00	1.53
3	600376	首开股份	1,419,800	6,957,020.00	1.26
4	601169	北京银行	830,700	6,305,013.00	1.14
5	601288	农业银行	2,361,000	5,713,620.00	1.03
6	600795	国电电力	1,400,000	3,304,000.00	0.60
7	600383	金地集团	454,200	3,143,064.00	0.57
8	300137	先河环保	140,000	2,937,200.00	0.53
9	600266	北京城建	299,959	2,915,601.48	0.53
10	000002	万科A	352,700	2,853,343.00	0.51

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	30,000,000.00	5.41
	其中:政策性金融债	30,000,000.00	5.41
4	企业债券	343,777,189.54	62.03
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	399,643,500.00	72.11
7	可转债	71,880,010.00	12.97
8	其他	-	-
9	合计	845,300,699.54	152.52

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	140410	14农发10	300,000	30,000,000.00	5.41
2	101456004	14北车MTN001	300,000	29,865,000.00	5.39
3	113001	中行转债	290,000	28,399,700.00	5.12
4	1280295	12临沂经开债	250,000	25,070,000.00	4.52
5	122149	12石化01	250,000	23,950,000.00	4.32

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国债期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.9.3 本期国债期货投资评价

无

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 本基金投资前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的投资决策程序说明:

12石化01发行人中国石油化工股份有限公司位于青岛经济技术开发区的东黄复线原油管道于2013年11月22日凌晨发生破裂,导致原油泄漏,国务院成立专门调查组对事故进行了分析调查,事故有关责任单位和责任人已处理,公司将承担其相应赔偿责任,资金主要来自中国石化的安全生产保险基金和保险理赔资金。目前公司总体生产经营和财务状况保持稳定,对债券投资无影响。

5.10.2 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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	511,110.76
2	应收证券清算款	6,000,838.20
3	应收股利	-
4	应收利息	18,855,896.49
5	应收申购款	24,800.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	25,392,645.45

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113001	中行转债	28,399,700.00	5.12
2	110020	南山转债	16,178,400.00	2.92
3	110022	同仁转债	7,219,200.00	1.30
4	110011	歌华转债	6,785,100.00	1.22
5	110017	中海转债	4,567,500.00	0.82
6	110012	海运转债	3,579,450.00	0.65
7	110018	国电转债	3,099,000.00	0.56

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末前十名股票不存在流通受限的情况。

5.10.6 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	工银添颐债券A	工银添颐债券B
报告期期初基金份额总额	224,511,838.59	378,650,332.81
报告期期间基金总申购份额	6,259,867.81	35,719,361.33
减:报告期期间基金总赎回份额	62,373,465.64	130,399,692.31
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	168,398,240.76	283,970,001.83

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本基金管理人本报告期内运用固有资金投资本基金情况未有变化。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准工银瑞信添颐债券型证券投资基金设立的文件;
2、《工银瑞信添颐债券型证券投资基金基金合同》;
3、《工银瑞信添颐债券型证券投资基金托管协议》;
4、基金管理人业务资格批件和营业执照;
5、基金托管人业务资格批件和营业执照;
6、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

9.2 存放地点

基金管理人或基金托管人住所。

9.3 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。