

工银瑞信产业债债券型证券投资基金

2013年12月31日

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易原则的执行情况

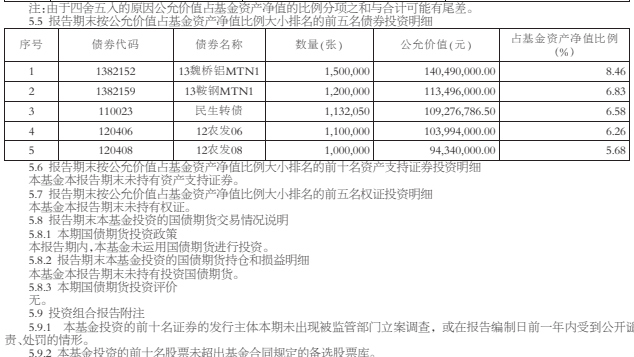
为了维护基金份额持有人利益，避免出现不正当关联交易，利益输送等违法违规行为，公司根据《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《基金管理公司公平交易制度指导意见》和《中国证监会关于基金投资中防止利益冲突的指导意见》（证监发〔2008〕97号）等有关法律法规和规范性文件，起草了《公平交易管理制度》，对公平交易的各方当事人的公平对待作了明确的规定，并规定了对异常交易、债券持仓的价格和市场价格的差异分析，可存在合理性解释。利益输送等违法违规行为禁止进行。本报告期间，按照同日反向交易、价差比例限制、公司对基金提供条件且与同一证券相同市场条件的各投资组合，以及不同投资组合之间的同向交易、价差比例限制、不同投资组合之间不匹配的买卖、本基金及子基金与本基金管理人管理的其他投资组合之间发生违反法律规定的同向交易又无充分理由。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金和本报告期内没有出现异常的情况。本报告期间，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未成交的成交量占当日该证券成交量比例未达到交易所规定的标准。因此，不存在异常交易行为。

[illegible]

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	--	--
	其中:股票	--	--
2	固定收益投资	2,477,497,559.05	96.16
	其中:债券	2,477,497,559.05	96.16
	资产支持证券	--	--
3	金融衍生品投资	--	--
4	买入返售金融资产	--	--
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	--	--
5	银行存款和结算备付金合计	26,085,861.01	1.01
6	其他资产	72,805,939.46	2.83
7	合计	2,576,389,359.52	100.00



5.0.3 其他资产构成				
序号	名称	金额(元)		
1	存出保证金	170,203.71		
2	应收证券清算款	10,125,063.41		
3	应收股利			
4	应收利息	62,506,313.84		
5	应收非流动资产	4,358.50		
6	其他应收款			
7	待摊费用			
8	其他			
9	合计	72,805,939.46		
5.0.4 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	110023	民生转债	109,276,786.50	6.58
2	110011	德华转债	19,289,765.80	1.16

3	期末	100,000,000.00	南兴特钢	5,374,869.60	0.32
59.5 投资组合期末十名股票持仓在流通受限情况说明 本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。 59.6 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：元					
	项目	工银产业债A	工银产业债B		
	报告期期初基金份额总额	725,978,100.71	1,982,644,230.51		
	报告期期间基金总申购额	2,259,913.42	1,251,262.85		
	减：报告期期间基金总赎回份额	220,843,912.68	774,125,757.01		

报告期期末基金份额总额(份额减少以“-”表示)	507,774,001.45	1,299,739,756.35
报告期期末基金份额总额(份额减少以“-”表示)	507,774,001.45	1,299,739,756.35
本基金管理人报告期内用固有资金投资本基金基本情况		
5.9 影响投资决策的其他重要信息		
1. 基金管理人于2013年10月30日在指定信息披露网站披露了《工银瑞信基金管理有限公司董事长变更公告》，李蔚鹏先生辞去公司董事长职务，董文亮先生接任该职务。		
2. 基金管理人于2013年12月28日在指定媒体网站上披露了《工银瑞信基金管理有限公司关于变更法定代表人公告》，法定代表人为董文亮男先生。		
5.9 备查文件目录		
4. 备查文件目录		

1. 中国证监会批准设立、拟设立产业并购基金非证券投资基金备案设立的文件；
2. 《中国银监会产业并购基金非证券投资基金备案合同》；
3. 中国银监会产业并购基金非证券投资基金托管协议；
4. 基金管理人业务资格和资质证明文件；
5. 基金管理人业务资格和资质证明文件；
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。

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期内本基金投资于本基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.8.2 本基金投资股指期货的投资政策

5.8.3 本基金运用股指期货的投资决策

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投资国债期货。

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 本基金投资的前十名证券的发行主体本报告期内未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。

5.10.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同约定的备选股票库。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	11,743.77
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	653.38
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—

9	合计	12,397.15
5.10.4	报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细	
	本基金报告期末未持有处于转股期的可转换债券。	
5.10.5	报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明	
5.10.5.1	报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明	
	本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。	
5.10.5.2	报告期末主动投资前十名股票中存在流通受限情况的说明	
	本基金本报告期末主动投资前五名股票中不存在流通受限情况。	
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
报告期期初基金份额总额	522,959,219.00	
报告期期间基金总申购份额	41,000,000.00	
减：报告期期间基金总赎回份额	\$8,000,000.00	
报告期期间基金净申购份额(份额减少以“-”填列)	-	
报告期末基金份额总额	505,959,219.00	

注：本基金已于2009年09月28日进行了基金份额折算，折算比例为0.6396/40.93。

5.7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本基金基金管理人本报告期运用固有资金投资本基金情况无变化。

5.8 对影响投资决策的重大事项

1、基金管理人于2013年10月30日在指定媒体及公司网站上披露了《工银瑞信基金管理有限公司董事长变更公告》，李锡卿先生辞去公司董事职务，董荣光先生更为新任董事长；

2、基金管理人于2013年12月28日在指定媒体及公司网站上披露了《工银瑞信基金管理有限公司关于变更法定代表人的公告》，法定代表人变更为郭特华女士。

5.9 网络交易项目目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会核准并上证中央企业50交易型开放式指数证券投资基金募集的文件；

2、上证中央企业50交易型开放式指数证券投资基金基金合同；

3、上证中央企业50交易型开放式指数证券投资基金托管协议；

4、基金管理人业务资格批文、营业执照；

5、基金托管人业务资格批文、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

备查文件存放于基金管理人或基金托管人的办公场所。

9.3 查阅方式

在投资者持有基金管理人或基金托管人的办公场所、营业场所及网站免费查阅备查文件，在支付工本费后，投资者可在合理期限内取得有关文件的复印件或复印件。