

工银瑞信宁瑞 6 个月持有期混合型证券投资  
基金  
2023 年第 4 季度报告

2023 年 12 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：宁波银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 1 月 19 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。

基金托管人宁波银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 1 月 17 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 2023 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## §2 基金产品概况

|            |  |
|------------|--|
| 基金简称       | 工银宁瑞 6 个月持有期混合   |
| 基金主代码      | 011387   |
| 基金运作方式     | 契约型开放式   |
| 基金合同生效日    | 2021 年 5 月 18 日  |
| 报告期末基金份额总额 | 299,480,589.42 份   |
| 投资目标       | 在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过资产配置，力求实现基金资产的持续稳健增值。  |
| 投资策略       | 本基金将由投资研究团队及时跟踪市场环境变化，根据对国际及国内宏观经济运行态势、宏观经济政策变化、证券市场运行状况等因素的深入研究，判断证券市场的发展趋势，结合行业状况、公司价值性和成长性分析，综合评价各类资产的风险收益水平。在充分的宏观形势判断和策略分析的基础上，执行“自上而下”的资产配置及动态调整策略。在市场上涨阶段中，增加权益类资产配置比例；在市场下行周期中，增加非权益类资产配置比例，最终力求实现基金资产 |

|                 |   |                     |
|-----------------|---|---------------------|
|                 | <p>组合收益的最大化，从而有效提高不同市场状况下基金资产的整体收益水平。</p> <p>本基金在债券投资与研究方面，实行投资策略研究专业化分工制度，专业研究人员分别从利率、债券信用风险等角度，提出独立的投资策略建议，经固定收益投资团队讨论，并经投资决策委员会批准后形成指导性投资策略。</p> <p>本基金采取“自上而下”与“自下而上”相结合的分析方法进行股票投资。基金管理人在行业分析的基础上，选择治理结构完善、经营稳健、业绩优良、具有可持续增长前景或价值被低估的上市公司股票，以合理价格买入并进行中长期投资。本基金股票投资具体包括行业分析与配置、公司财务状况评价、价值评估及股票选择与组合优化等过程。</p> |                     |
| 业绩比较基准          | 中证 800 指数收益率×10%+中证港股通综合指数（人民币）收益率×5%+中债综合指数收益率×85%   |                     |
| 风险收益特征          | 本基金为混合型基金，预期收益和风险水平低于股票型基金，高于债券型基金与货币市场基金。本基金可能投资港股通投资标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。  |                     |
| 基金管理人           | 工银瑞信基金管理有限公司  |                     |
| 基金托管人           | 宁波银行股份有限公司  |                     |
| 下属分级基金的基金简称     | 工银宁瑞 6 个月持有期混合<br>A   | 工银宁瑞 6 个月持有期混合<br>C |
| 下属分级基金的交易代码     | 011387  | 011388              |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 290,660,201.49 份  | 8,820,387.93 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（2023 年 10 月 1 日-2023 年 12 月 31 日） |                  |
|-----------------|---------------------------------------|------------------|
|                 | 工银宁瑞 6 个月持有期混合 A                      | 工银宁瑞 6 个月持有期混合 C |
| 1. 本期已实现收益      | 1,999,664.73                          | 49,992.14        |
| 2. 本期利润         | -2,876,828.35                         | -92,600.57       |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0095                               | -0.0102          |
| 4. 期末基金资产净值     | 292,367,618.60                        | 8,779,362.49     |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.0059                                | 0.9953           |

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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 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

工银宁瑞 6 个月持有期混合 A

| 阶段             | 净值增长率① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①-③    | ②-④   |
|----------------|--------|---------------|----------------|-----------------------|--------|-------|
| 过去三个月          | -0.90% | 0.24%         | -0.28%         | 0.13%                 | -0.62% | 0.11% |
| 过去六个月          | -0.85% | 0.23%         | -0.93%         | 0.13%                 | 0.08%  | 0.10% |
| 过去一年           | 1.12%  | 0.23%         | 0.09%          | 0.13%                 | 1.03%  | 0.10% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 0.59%  | 0.23%         | -1.70%         | 0.16%                 | 2.29%  | 0.07% |

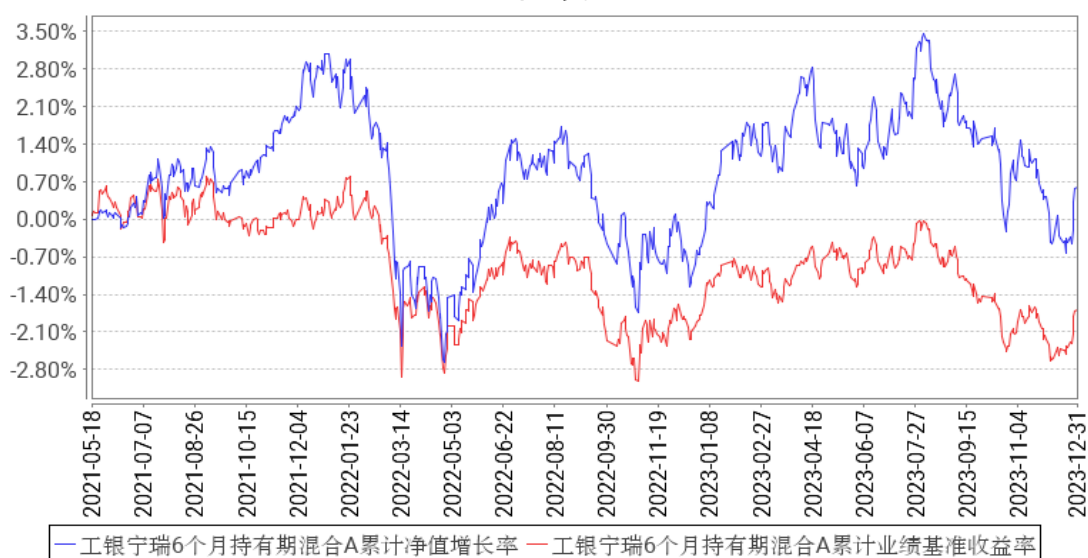
工银宁瑞 6 个月持有期混合 C

| 阶段    | 净值增长率① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①-③    | ②-④   |
|-------|--------|---------------|----------------|-----------------------|--------|-------|
| 过去三个月 | -1.00% | 0.24%         | -0.28%         | 0.13%                 | -0.72% | 0.11% |
| 过去六个月 | -1.05% | 0.24%         | -0.93%         | 0.13%                 | -0.12% | 0.11% |

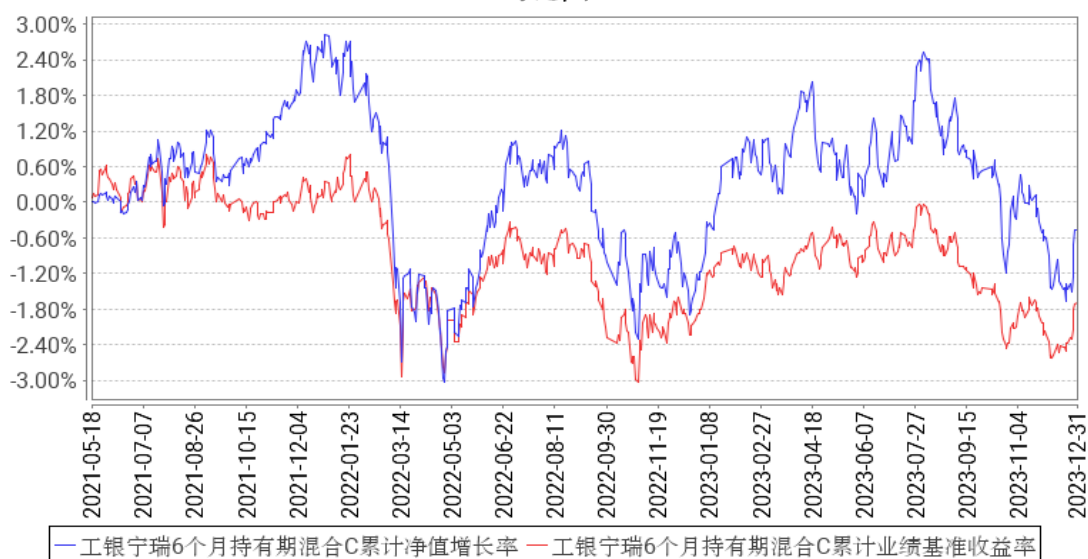
|            |        |       |        |       |       |       |
|------------|--------|-------|--------|-------|-------|-------|
| 过去一年       | 0.71%  | 0.23% | 0.09%  | 0.13% | 0.62% | 0.10% |
| 自基金合同生效起至今 | -0.47% | 0.23% | -1.70% | 0.16% | 1.23% | 0.07% |

### 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

工银宁瑞6个月持有期混合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



工银宁瑞6个月持有期混合C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2021年5月18日生效。

2、根据基金合同规定，本基金建仓期为6个月。截至本报告期末，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。

### 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 |        |  |
| 何秀红 | 固定收益部副总经理、本基金的基金经理 | 2021 年 5 月 18 日 | -    | 16 年   | 硕士研究生。曾任广发证券股份有限公司债券研究员；2009 年加入工银瑞信，现任固定收益部副总经理、基金经理。2011 年 2 月 10 日至今，担任工银瑞信四季收益债券型证券投资基金基金经理；2011 年 12 月 27 日至 2015 年 1 月 19 日，担任工银瑞信保本混合型证券投资基金基金经理；2012 年 11 月 14 日至 2020 年 1 月 9 日，担任工银瑞信信用纯债债券型证券投资基金基金经理；2013 年 3 月 29 日至今，担任工银瑞信产业债债券型证券投资基金基金经理；2013 年 5 月 22 日至今，担任工银瑞信信用纯债一年定期开放债券型证券投资基金基金经理；2013 年 6 月 24 日至 2018 年 2 月 23 日，担任工银瑞信信用纯债两年定期开放债券型证券投资基金基金经理；2015 年 10 月 27 日至今，担任工银瑞信丰收回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2016 年 9 月 12 日至今，担任工银瑞信瑞享纯债债券型证券投资基金基金经理；2018 年 7 月 25 日至今，担任工银瑞信添祥一年定期开放债券型证券投资基金基金经理；2018 年 7 月 27 日至 2020 年 6 月 11 日，担任工银瑞信银和利混合型证券投资基金基金经理；2019 年 4 月 30 日至 2020 年 12 月 14 日，担任工银瑞信尊利中短债债券型证券投资基金基金经理；2019 年 6 月 11 日至 2020 年 12 月 30 日，担任工银瑞信添慧债券型证券投资基金基金经理；2020 年 12 月 9 日至今，担任工银瑞信双盈债券型证券投资基金基金经理；2021 年 5 月 18 日至今，担任工银瑞信宁瑞 6 个月持有期混合型证券投资基金基金经理；2021 年 6 月 11 日至今，担 |

|  |  |  |  |  |   |
|--|--|--|--|--|---|
|  |  |  |  |  | 任工银瑞信双玺 6 个月持有期债券型证券投资基金基金经理；2021 年 10 月 26 日至今，担任工银瑞信稳健瑞盈一年持有期债券型证券投资基金基金经理。 |
|--|--|--|--|--|---|

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《基金从业人员管理规则》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 报告期内基金的投资策略和运作分析

宏观经济整体还处于总需求偏弱状态中，主要受到房地产行业趋势下行，制造业部分受到出口和政策支持，总体状况要好于其他部门。中下游行业的供需压力比较大，价格呈现下跌趋势。

政策层面，从中央经济工作会议定调来看，政策立足点仍在于战略层面的高质量发展，策略上兼顾稳增长工作，注意平滑地产、地方政府债务等传统经济领域风险，并通过适当的财政政策托底以保持必要的经济增速，但整体力度相对克制。货币政策总量宽松诉求降低、以配合财政为主。

债券市场方面，四季度债券资产对经济现状定价较为充分，交易主线在于资金面和政策预期。2023 年财政节奏相对靠后，四季度仍有较大体量国债待发行，叠加地方债务置换以及一万亿国债增发，使得四季度政府债券供给处于历史同期较高水平，进而导致银行间市场流动性摩擦加大。10-11 月债券收益率跟随着财政资金的上缴和投放节奏而波动，总体趋于上行，结构上短端收益率调整更多、曲线呈平坦化态势。12 月以后，随着中央经济工作会议定调稳增长力度不及预期，以及年末央行大额净投放呵护跨年流动性，债券情绪明显好转，收益率出现快速下行，曲线再度转为陡峭化。

股票市场方面，四季度市场情绪依然较弱，主要宽基指数均有下跌，资产估值进一步压缩。结构上，金融地产、建筑建材等顺周期板块表现较弱，煤炭、电子、医药等行业存在一定的相对收益。

报告期内，我们维持组合久期中性，经济基本面整体对债券偏有利，但是市场对于基本面预期比较悲观，收益率曲线平坦，主要配置在中短期的银行永续和高等级信用债。股票市场估值已经比较有吸引力，一些优质公司的估值已经下跌到合理甚至低估位置，因此我们维持了略高于中枢的仓位。行业配置比较均衡，组合以大盘蓝筹为主要持仓，公司质地和估值是我们重要选股标准。可转债方面以偏债标的为主要持仓。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金 A 份额净值增长率为-0.90%，本基金 A 份额业绩比较基准收益率为-0.28%；本基金 C 份额净值增长率为-1.00%，本基金 C 份额业绩比较基准收益率为-0.28%。

#### 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              | 75,912,422.58  | 20.33        |
|    | 其中：股票             | 75,912,422.58  | 20.33        |
| 2  | 基金投资              | -              | -            |
| 3  | 固定收益投资            | 292,403,692.64 | 78.31        |
|    | 其中：债券             | 292,403,692.64 | 78.31        |
|    | 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      | 4,873,604.18   | 1.31         |
| 8  | 其他资产              | 215,417.19     | 0.06         |
| 9  | 合计                | 373,405,136.59 | 100.00       |

注：1、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。

2、本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为5,988,730.00元，占期末资产净值比例为1.99%。

## 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         | -             | -            |
| B  | 采矿业              | 1,922,578.00  | 0.64         |
| C  | 制造业              | 40,138,638.22 | 13.33        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 5,085,152.00  | 1.69         |
| E  | 建筑业              | 2,959,910.00  | 0.98         |
| F  | 批发和零售业           | -             | -            |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 2,144,318.00  | 0.71         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -             | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 4,363,252.36  | 1.45         |
| J  | 金融业              | 6,389,092.00  | 2.12         |
| K  | 房地产业             | 2,237,960.00  | 0.74         |
| L  | 租赁和商务服务业         | -             | -            |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 4,682,792.00  | 1.55         |

|   |               |               |       |
|---|---------------|---------------|-------|
| 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            | 69,923,692.58 | 23.22 |

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

| 行业类别                          | 公允价值（人民币）    | 占基金资产净值比例（%） |
|-------------------------------|--------------|--------------|
| 通信服务 Communication Services   | 4,866,360.00 | 1.62         |
| 非必需消费品 Consumer Discretionary | 111,330.00   | 0.04         |
| 必需消费品 Consumer Staples        | -            | -            |
| 能源 Energy                     | 471,200.00   | 0.16         |
| 金融 Financials                 | -            | -            |
| 保健 Health Care                | -            | -            |
| 工业 Industrials                | 539,840.00   | 0.18         |
| 信息技术 Information Technology   | -            | -            |
| 材料 Materials                  | -            | -            |
| 房地产 Real Estate               | -            | -            |
| 公用事业 Utilities                | -            | -            |
| 合计                            | 5,988,730.00 | 1.99         |

注：1、以上分类采用全球行业分类标准（GICS）；

2、由于四舍五入的原因市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 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

### 5.3.1 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  | 600941 | 中国移动 | 21,000  | 2,089,080.00 | 0.69         |
| 1  | 00941  | 中国移动 | 28,500  | 1,673,520.00 | 0.56         |
| 2  | 600900 | 长江电力 | 160,000 | 3,734,400.00 | 1.24         |
| 3  | 603259 | 药明康德 | 49,200  | 3,579,792.00 | 1.19         |
| 4  | 600660 | 福耀玻璃 | 86,200  | 3,223,018.00 | 1.07         |
| 5  | 00700  | 腾讯控股 | 12,000  | 3,192,840.00 | 1.06         |
| 6  | 600887 | 伊利股份 | 107,300 | 2,870,275.00 | 0.95         |
| 7  | 600183 | 生益科技 | 155,800 | 2,852,698.00 | 0.95         |

|    |        |      |        |              |      |
|----|--------|------|--------|--------------|------|
| 8  | 000858 | 五粮液  | 20,000 | 2,806,200.00 | 0.93 |
| 9  | 002415 | 海康威视 | 80,000 | 2,777,600.00 | 0.92 |
| 10 | 600036 | 招商银行 | 90,000 | 2,503,800.00 | 0.83 |

#### 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      | 7,036,630.14   | 2.34         |
| 2  | 央行票据      | -              | -            |
| 3  | 金融债券      | 197,189,587.49 | 65.48        |
|    | 其中：政策性金融债 | 41,779,196.72  | 13.87        |
| 4  | 企业债券      | 30,578,761.64  | 10.15        |
| 5  | 企业短期融资券   | -              | -            |
| 6  | 中期票据      | -              | -            |
| 7  | 可转债（可交换债） | 57,598,713.37  | 19.13        |
| 8  | 同业存单      | -              | -            |
| 9  | 其他        | -              | -            |
| 10 | 合计        | 292,403,692.64 | 97.10        |

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  | 2128038 | 21 农业银行永续债 01 | 250,000 | 25,689,513.66 | 8.53         |
| 2  | 2128017 | 21 中信银行永续债    | 200,000 | 21,171,016.39 | 7.03         |
| 3  | 210305  | 21 进出 05      | 200,000 | 20,808,218.58 | 6.91         |
| 4  | 2028006 | 20 邮储银行永续债    | 200,000 | 20,800,190.16 | 6.91         |
| 5  | 2128025 | 21 建设银行二级 01  | 200,000 | 20,595,180.33 | 6.84         |

#### 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中，中国农业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行、国家金融监管总局、地方外管局的处罚；中信银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监管总局、地方证监局的处罚；中国进出口银行在报告编制日前一年内曾受到中国银行间市场交易商协会的处罚；中国邮政储蓄银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行、地方证监局的处罚；中国建设银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行间市场交易商协会、中国银保监会、国家金融监管总局的处罚；上海浦东发展银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到地方证监局的处罚；中国银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银保监会、中国人民银行、国家金融监管总局、地方银监局的处罚；交通银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行间市场交易商协会、地方证监局的处罚。

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。

### 5.11.2 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。

### 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（元）      |
|----|---------|------------|
| 1  | 存出保证金   | 15,834.84  |
| 2  | 应收证券清算款 | 194,328.77 |
| 3  | 应收股利    | -          |
| 4  | 应收利息    | -          |
| 5  | 应收申购款   | 5,253.58   |
| 6  | 其他应收款   | -          |
| 7  | 其他      | -          |
| 8  | 合计      | 215,417.19 |

### 5.11.4 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  | 110059 | 浦发转债     | 18,501,306.61 | 6.14         |
| 2  | 113021 | 中信转债     | 6,735,309.04  | 2.24         |
| 3  | 113052 | 兴业转债     | 4,343,445.07  | 1.44         |
| 4  | 110073 | 国投转债     | 3,285,069.04  | 1.09         |
| 5  | 127022 | 恒逸转债     | 3,048,075.62  | 1.01         |
| 6  | 113043 | 财通转债     | 2,229,564.38  | 0.74         |
| 7  | 128131 | 崇达转 2    | 2,205,120.94  | 0.73         |
| 8  | 110076 | 华海转债     | 2,162,745.21  | 0.72         |
| 9  | 128035 | 大族转债     | 2,092,443.84  | 0.69         |
| 10 | 127012 | 招路转债     | 2,022,192.11  | 0.67         |
| 11 | 113050 | 南银转债     | 1,748,217.85  | 0.58         |
| 12 | 127049 | 希望转 2    | 1,566,169.23  | 0.52         |
| 13 | 132018 | G 三峡 EB1 | 1,545,626.03  | 0.51         |
| 14 | 110079 | 杭银转债     | 1,428,998.37  | 0.47         |
| 15 | 110047 | 山鹰转债     | 1,203,074.70  | 0.40         |
| 16 | 110067 | 华安转债     | 1,056,433.35  | 0.35         |
| 17 | 113037 | 紫银转债     | 898,102.55    | 0.30         |
| 18 | 127025 | 冀东转债     | 725,431.86    | 0.24         |
| 19 | 128129 | 青农转债     | 614,815.73    | 0.20         |
| 20 | 113623 | 凤 21 转债  | 186,571.84    | 0.06         |

注：上表包含期末持有的处于转股期的可转换债券和可交换债券明细。

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

### 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

| 项目                        | 工银宁瑞 6 个月持有期混<br>合 A | 工银宁瑞 6 个月持有期混<br>合 C |
|---------------------------|----------------------|----------------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 319,516,790.28       | 9,299,224.97         |
| 报告期期间基金总申购份额              | 380,169.73           | 17,913.47            |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 29,236,758.52        | 496,750.51           |
| 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               | 290,660,201.49       | 8,820,387.93         |

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

无。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

## §8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 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。

### 8.2 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、中国证监会准予工银瑞信宁瑞 6 个月持有期混合型证券投资基金募集申请的注册文件；
- 2、《工银瑞信宁瑞 6 个月持有期混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《工银瑞信宁瑞 6 个月持有期混合型证券投资基金托管协议》；

- 4、《工银瑞信宁瑞 6 个月持有期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规定媒介上披露的各项公告。

## 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。

工银瑞信基金管理有限公司

2024 年 1 月 19 日