

工银瑞信价值稳健 6 个月持有期混合型基
金中基金（FOF）
2024 年第 2 季度报告

2024 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：招商银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 7 月 18 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年7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2024年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

| | |
|------------|--|
| 基金简称 | 工银价值稳健6个月持有混合（FOF） |
| 基金主代码 | 013300 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2021年11月9日 |
| 报告期末基金份额总额 | 582,062,544.96份 |
| 投资目标 | 在进一步分散投资风险的要求下，本基金通过稳健配置各类型资产，以获取长期稳健的投资收益，并力争超越业绩比较基准。 |
| 投资策略 | 在大类资产配置策略方面，大类资产配置注重自上而下的分析与判断，重点把握各大类资产的长期风险收益特征及投资定位，在能力范围内依据宏观经济、资本市场形势把握各类资产大的变动趋势，以获取资产配置带来的系统性β收益和择时α收益。其具体分为战略资产配置、战术资产配置和纪律性再平衡。在底层资产投资策略方面，在“自上而下”的资产配置指导框架下，本基金将基于区分基金经理能力和运气的 |

| | | |
|-----------------|--|---------------------|
| | 思路“自下而上”精选投资标的，具体的投资工具除证券投资基金外，本基金还可以适当参与股票及债券等的投资。 | |
| 业绩比较基准 | 中证800指数收益率×10%+中债-新综合财富(总值)指数收益率×90%。 | |
| 风险收益特征 | 本基金作为混合型基金中基金，其预期收益和风险水平低于股票型基金、股票型基金中基金，高于债券型基金、债券型基金中基金、货币市场基金、货币型基金中基金。 | |
| 基金管理人 | 工银瑞信基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 招商银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 工银价值稳健6个月持有混合（FOF）A | 工银价值稳健6个月持有混合（FOF）C |
| 下属分级基金的交易代码 | 013300 | 013301 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 567,134,760.43份 | 14,927,784.53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（2024年4月1日-2024年6月30日） | |
|-----------------|---------------------------|---------------------|
| | 工银价值稳健6个月持有混合（FOF）A | 工银价值稳健6个月持有混合（FOF）C |
| 1. 本期已实现收益 | -3,582,080.04 | -110,735.58 |
| 2. 本期利润 | 2,144,943.18 | 43,441.35 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0037 | 0.0028 |
| 4. 期末基金资产净值 | 553,509,878.41 | 14,415,899.29 |
| 5. 期末基金份额净值 | 0.9760 | 0.9657 |

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

工银价值稳健6个月持有混合（FOF）A

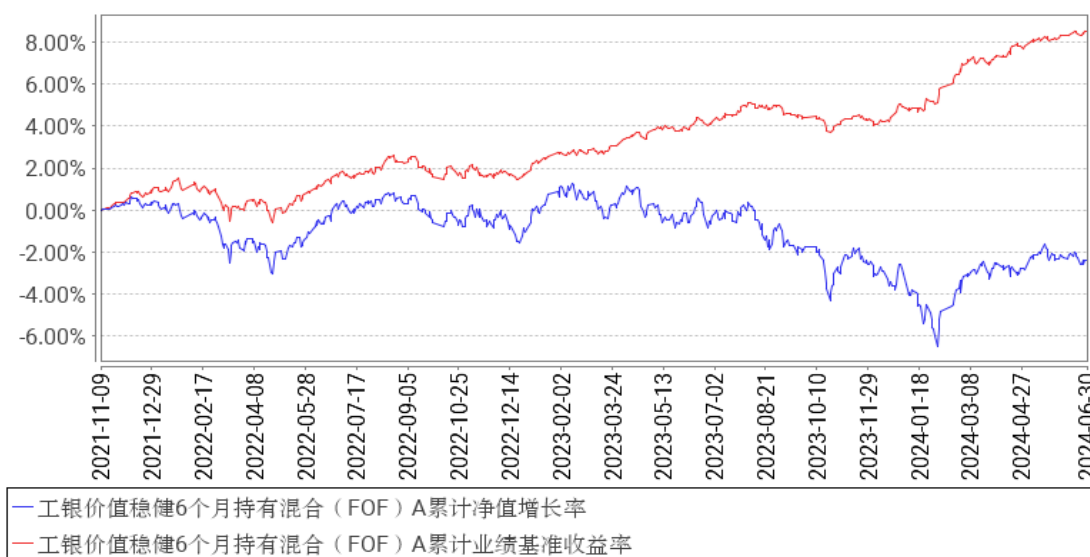
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率 标准差② | 业绩比较基 准收益率③ | 业绩比较基 准收益率标 准差④ | ①—③ | ②—④ |
|----------------|--------|---------------|----------------|-----------------------|---------|-------|
| 过去三个月 | 0.37% | 0.18% | 1.25% | 0.08% | -0.88% | 0.10% |
| 过去六个月 | 0.20% | 0.26% | 3.25% | 0.10% | -3.05% | 0.16% |
| 过去一年 | -2.14% | 0.26% | 4.08% | 0.09% | -6.22% | 0.17% |
| 自基金合同 生效起至今 | -2.40% | 0.23% | 8.49% | 0.11% | -10.89% | 0.12% |

工银价值稳健6个月持有混合（FOF）C

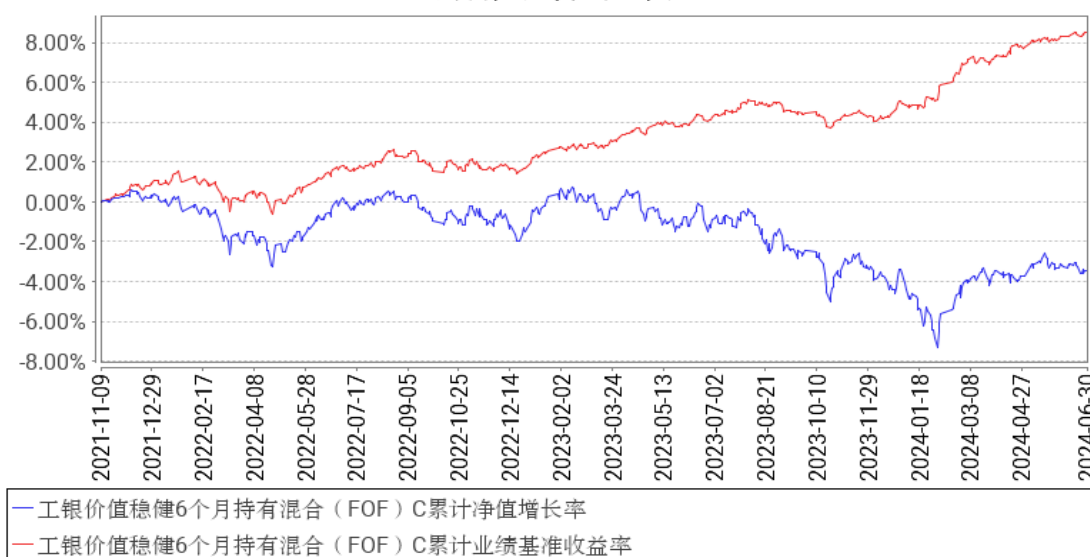
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率 标准差② | 业绩比较基 准收益率③ | 业绩比较基 准收益率标 准差④ | ①—③ | ②—④ |
|----------------|--------|---------------|----------------|-----------------------|---------|-------|
| 过去三个月 | 0.27% | 0.18% | 1.25% | 0.08% | -0.98% | 0.10% |
| 过去六个月 | -0.01% | 0.26% | 3.25% | 0.10% | -3.26% | 0.16% |
| 过去一年 | -2.53% | 0.26% | 4.08% | 0.09% | -6.61% | 0.17% |
| 自基金合同 生效起至今 | -3.43% | 0.23% | 8.49% | 0.11% | -11.92% | 0.12% |

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

工银价值稳健6个月持有混合（FOF）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



工银价值稳健6个月持有混合（FOF）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11月9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 | 说明 |
|----|----|-------------|------|----|
|----|----|-------------|------|----|

| | | 任职日期 | 离任日期 | 年限 | |
|-----|---------------------|------------|------|-----|---|
| 蒋华安 | FOF 投资部总经理、本基金的基金经理 | 2021年11月9日 | - | 15年 | <p>硕士研究生。曾任安永会计师事务所担任高级审计员，社保基金理事会资产配置处副处长；2017年加入工银瑞信，现任 FOF 投资部总经理、基金经理。2018年10月31日至今，担任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）基金经理；2019年9月17日至今，担任工银瑞信养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金经理；2020年1月21日至今，担任工银瑞信养老目标日期 2045 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金经理；2020年9月30日至今，担任工银瑞信稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金经理；2021年11月9日至今，担任工银瑞信价值稳健6个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金经理；2021年11月24日至今，担任工银瑞信睿智进取一年封闭运作股票型基金中基金（FOF-LOF）（自2022年11月24日起，变更为工银瑞信睿智进取股票型基金中基金（FOF-LOF））基金经理；2021年12月22日至今，担任工银瑞信平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金经理；2022年8月31日至今，担任工银瑞信安裕积极一年持有期混合型基金中基金（FOF）基金经理；2023年6月28日至今，担任工银瑞信安悦稳健养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）基金经理。</p> |
| 徐心远 | 本基金的基金经理 | 2021年12月1日 | - | 7年 | <p>硕士研究生。2016年加入工银瑞信，现任 FOF 投资部基金经理。2021年12月1日至今，担任工银瑞信价值稳健6个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金经理；2024年1月3日至今，担任工银瑞信养老目标日期 2050 五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金经理；2024年1月3日至今，担任工银瑞信养老目标日期 2060 五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金经理；2024年1月3日至今，担任工银瑞信养老目标日期 2055 五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）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《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，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2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

二季度，全球经济复苏力度有所减弱，不同经济体分化明显，通胀水平总体区间震荡，压力边际缓解，主要国家央行货币政策陆续转向，具体节奏仍有较大不确定性。二季度，受内需乏力

影响，国内经济弱于预期，缺乏显著增长动能。结构上，消费不温不火，地产投资继续重度拖累，基建投资边际转弱，出口持续高景气支撑制造业投资高位震荡。国内通胀总体平稳，上行压力较小。财政政策保持适当支出强度，累计发行三期超长期特别国债，支持力度有待进一步增强。货币政策总体较为克制，名义利率稳中有降，实际利率仍处高位。受多重内外部不利因素抑制，市场风险偏好持续下行。

在此背景下，二季度各大类资产延续分化态势。权益资产方面，A股整体呈现先涨后跌，价值继续好于成长，大盘好于小盘。境内主动权益类基金小幅下跌，总体跑赢中证800。境外股市整体上行，内部出现分化，美印股市继续震荡上行，屡创历史新高，欧日股市小幅下跌。固收资产方面，境内外债市继续分化，境内债券收益率继续震荡下行，利率债好于信用债，转债先涨后跌，境外债券收益率先涨后跌，整体小幅上行。商品方面，原油、农产品小幅下跌，黄金、工业品大幅上涨。汇率方面，美元指数继续大幅上行，人民币相对美元小幅贬值。

二季度，本基金权益仓位稳中有降，以内部结构调整为主。四月份，受美国通胀数据超预期影响，海外股债大幅波动，本基金降低了纳指生物、国内成长等利率敏感型基金比例，提升资源类、价值类基金占比，并购买了估值处于较低位置、受益于外资流入的港股基金。五月份，美国通胀数据弱于预期，境外市场出现分化，美股科技一枝独秀屡创新高，其他股市及板块回升力度偏弱，本基金降低了资源类基金占比，提升了港股红利、恒生科技和A股全市场基金占比。同时，考虑到日元持续的贬值压力和主动基金显著负超额，本基金清仓了日本基金。六月份，半导体周期见底回升，本基金增加了消费电子等板块配置。二季度末，本基金穿透后权益仓位处于中性水平，结构上较为分散，继续偏向全市场型基金、海外QD基金、价值类基金。债券基金方面，本基金变动较少，仍继续将含权债基转换为纯债债基。

展望未来一段时间，宏观经济方面，全球经济增长动能预计边际趋弱，缺乏显著、可持续的驱动力量，不确定性加大。增长方面，美国等发达经济体有望温和放缓，印度等新兴经济体预计高位震荡。国内经济短期依然面临房地产下行及高杠杆带来的显著拖累，内需不足仍然是当前的主要矛盾，同时外需在地缘政治及贸易冲突风险加大的背景下面临一定扰动。中期仍将处于较长时间的结构调整期，需要继续寻找新动能，更加积极的财政政策是平稳过渡的重要保障。通胀方面，全球通胀预计短期震荡走弱，中期中枢上移，存在结构性压力。国内通胀有望继续温和回升，但仍处于较低水平，供过于求的状态短期内难以改变。流动性方面，全球央行陆续转向，美联储政策转向落地时机仍是重中之重，预计将在下半年进行预防性降息。国内流动性将继续保持合理充裕，短期仍面临较大的稳汇率压力，中期有望跟随美联储政策转向步伐，降低偏高的实际利率。风险偏好方面，以“国九条”为代表的新一轮资本市场结构性改革有望长期改变A股生

态，但短期仍将受美国大选、美联储政策节奏、国内政策力度等诸多内外部不确定性因素拖累。

资产配置方面，面对不确定性加大的环境，策略分散化仍是重要的应对之策，战略上更加注重“矛”与“盾”之间的平衡，战术上以把握结构性机会为主。权益资产方面，A股在震荡回落后处于区间下沿附近，下行空间有限，低位择机适度加仓。结构上，高股息策略仍是基石，在内外部环境没有逆转前继续抱团难以避免，战术上关注结构性景气改善及超跌带来的投资机会，同时战略上继续重视美股的投资机会。固收资产方面，利率债中长期胜率仍然较高，收益率有望继续震荡下行，短期冲击是较好的加仓机会，保持中性偏高久期。此外，继续重点关注美债、黄金等资产的长期战略性配置机会。

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0.37%，本基金A份额业绩比较基准收益率为1.25%；本基金C份额净值增长率为0.27%，本基金C份额业绩比较基准收益率为1.25%。

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 | - | - |
| | 其中：股票 | - | - |
| 2 | 基金投资 | 557,453,998.10 | 91.13 |
| 3 | 固定收益投资 | 32,072,997.95 | 5.24 |
| | 其中：债券 | 32,072,997.95 | 5.24 |
| | 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 | 9,000,000.00 | 1.47 |
| | 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 | 13,075,560.97 | 2.14 |
| 8 | 其他资产 | 91,646.07 | 0.01 |
| 9 | 合计 | 611,694,203.09 | 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

本基金本报告期末未持有境内股票投资。

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 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

本基金本报告期末未持有股票。

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 | 32,072,997.95 | 5.65 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 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） | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 32,072,997.95 | 5.65 |

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 | 019727 | 23 国债 24 | 315,000 | 32,072,997.95 | 5.65 |

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。

5.11.2 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 | 30,821.42 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 9,920.63 |
| 6 | 其他应收款 | 50,904.02 |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 91,646.07 |

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

无。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§6 基金中基金

6.1 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基金投资明细

| 序号 | 基金代码 | 基金名称 | 运作方式 | 持有份额 (份) | 公允价值(元) | 占基金资产 净值比例(%) | 是否属于基金 管理人及管理人 关联方所管理的基金 |
|----|--------|---------------------|--------------|---------------|----------------|------------------|--------------------------------|
| 1 | 000403 | 工银纯债债券B | 契约型开放式 | 93,975,153.58 | 110,016,712.30 | 19.37 | 是 |
| 2 | 161119 | 易方达中债新综指发起式(LOF)A | 上市开放式基金(LOF) | 36,721,005.43 | 62,161,317.99 | 10.95 | 否 |
| 3 | 100050 | 富国全球债券(QDII)人民币A | 契约型开放式 | 40,091,181.66 | 52,210,745.88 | 9.19 | 否 |
| 4 | 003358 | 易方达中债7-10年期国开行债券指数A | 契约型开放式 | 39,912,755.85 | 51,076,353.66 | 8.99 | 否 |
| 5 | 511260 | 十年国债ETF | 交易型开放式 | 342,010.00 | 44,163,751.30 | 7.78 | 否 |
| 6 | 485011 | 工银双利债券B | 契约型开放式 | 19,505,413.18 | 33,861,397.28 | 5.96 | 是 |
| 7 | 164808 | 工银四季收益债券A | 上市开放式基金(LOF) | 28,649,648.89 | 31,302,606.38 | 5.51 | 是 |
| 8 | 007360 | 易方达中短期美元债债券 | 契约型开放式 | 18,098,642.53 | 20,382,691.22 | 3.59 | 否 |

| | | | | | | | |
|----|--------|----------------|--------|---------------|---------------|------|---|
| | | (QDII)A(人民币份额) | | | | | |
| 9 | 000893 | 工银创新动力股票 | 契约型开放式 | 14,477,751.19 | 15,230,594.25 | 2.68 | 是 |
| 10 | 166301 | 华商新趋势优选混合 | 契约型开放式 | 1,343,076.40 | 12,251,542.92 | 2.16 | 否 |

6.1.1 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公开募集基础设施证券投资基金投资明细

本基金本报告期末未持有公开募集基础设施证券投资基金。

6.1.2 报告期末基金持有的全部公开募集基础设施证券投资基金情况

本基金本报告期末未持有公开募集基础设施证券投资基金。

6.2 当期交易及持有基金产生的费用

| 项目 | 本期费用 2024年4月1日至2024年6月30日 | 其中：交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用 |
|----------------------|---------------------------|---------------------------------|
| 当期交易基金产生的申购费（元） | 1,932.42 | - |
| 当期交易基金产生的赎回费（元） | 22,606.42 | 1,389.38 |
| 当期持有基金产生的应支付销售服务费（元） | 180,616.64 | 153,578.55 |
| 当期持有基金产生的应支付管理费（元） | 753,791.93 | 271,935.46 |
| 当期持有基金产生的应支付托管费（元） | 187,453.81 | 76,252.33 |
| 当期持有基金产生的应支付交易费用（元） | 2,248.86 | 105.83 |

注：上述当期持有基金产生的应支付销售服务费、当期持有基金产生的应支付管理费、当期持有基金产生的应支付托管费，是根据被投资基金的实际持仓情况和被投资基金的基金合同约定费率估算得出。该三项费用根据被投资基金的基金合同约定已经作为费用计入被投资基金的基金份额净值，已在本基金所持有基金的净值中体现，不构成本基金的费用。

根据相关法律法规及本基金合同的约定，本基金不得对基金中基金财产中持有的自身管理的基金部分收取管理费，本基金的基金托管人不得对基金中基金财产中持有的自身托管的基金部分收取托管费。基金管理人运用本基金财产申购自身管理的其他基金（ETF除外）的，应当通过直销渠道申购且不收取申购费、赎回费（按照相关法规、招募说明书约定应当收取并计入基金资产的赎回费用除外）、销售服务等销售费用。相关申购费、赎回费由基金管理人直接减免，相关销

售服务费由基金管理人从被投资基金收取后返还至本基金基金资产。

6.3 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本基金持有的基金在报告期末发生重大影响事件。

§ 7 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 工银价值稳健6个月持有混合（FOF）A | 工银价值稳健6个月持有混合（FOF）C |
|---------------------------|---------------------|---------------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 600,825,278.82 | 16,006,965.17 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 14,098.73 | - |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 33,704,617.12 | 1,079,180.64 |
| 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 | 567,134,760.43 | 14,927,784.53 |

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。

§8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

8.1 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 | 51,160,339.71 |
| 报告期期间买入/申购总份额 | - |
| 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 | 51,160,339.71 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | 8.79 |

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。

8.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

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

无。

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价值稳健 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）募集申请的注册文件；

2、《工银瑞信价值稳健 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》；

3、《工银瑞信价值稳健 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）托管协议》；

4、《工银瑞信价值稳健 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）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

2024 年 7 月 18 日