

## 工银瑞信添颐债券型证券投资基金

## [2013] 第二季度报告

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:二〇一三年七月十八日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事及监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基金合同规定,于2013年7月12日复核了本报告中的财务指标、净值表现、净值增长率和净值增长率标准差等指标,保留在复核后,将复核结果报予基金管理人。

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。

本报告告期财务资料未经审计。

本报告告期自2013年4月1日起至6月30日止。

## § 2 基本产品概况

基金简称:工银添颐债券

交易代码:485114

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:1,151,895,149.92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,为实现超越业绩比较基准的长期投资回报,为投资者提供稳定的收入。

本基金将在所选二级市场基础上,通过组合投资品种投资策略构建债券基金的平稳收益,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。

投资策略:本基金将通过资产配置策略,在央行的主动投放货币的背景下,资金价格仍将处于较高位置。

经济的持续下行对利率债和高等级信用债有一定支撑,可转债和股票在企业盈利下滑、资金价格偏高的条件下难有趋势性行情。2013年3季度,本基金将维持长期策略,提升组合的信用质量,在可转债和股票方面将侧重做好波段操作与结构调整。

§ 3 投资组合报告

## 5.1 报告期末基金资产组合情况

金额(元) 占基金总资产的比例(%)

1 权益投资 28,532,269.08 1.34

其中:股票 28,532,269.08 1.34

2 固定收益投资 1,752,602,977.62 82.12

其中:债券 1,752,602,977.62 82.12

3 金融衍生品投资 - -

4 买入返售金融资产 - -

金融资产 - -

5 银行存款和结算备付金合计 262,388,132.11 12.29

6 其他资产 90,754,183.30 4.25

7 合计 2,134,277,562.11 100.00

注:因报告期末持有的部分基金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

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 28,532,269.08 1.99

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 - -

G 交通运输、仓储和邮政业 - -

H 餐饮业和住宿业 - -

I 信息传输、软件和信息技术服务业 - -

J 金融业 - -

K 房地产业 - -

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 - -

注:因报告期末持有的部分基金占基金总资产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名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 000085 同仁堂 400,000 8,752,000.00 0.61

2 600597 光明乳业 500,000 6,745,000.00 0.47

3 000895 双汇发展 143,200 5,508,608.00 0.38

4 002643 烟台万润 224,706 3,388,566.48 0.24

5 600519 贵州茅台 9,100 1,750,567.60 0.12

6 600887 伊利股份 40,000 1,251,200.00 0.09

7 002080 中材科技 79,410 1,140,327.60 0.08

注:因报告期末持有的部分基金占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

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 89,754,000.00 6.25

2 中央银行票据 - -

3 金融债券 - -

4 其中:政策性金融债 - -

5 企业债 1,061,455,538.82 73.90

6 中期票据 410,313,500.00 28.57

7 可转债 191,079,938.80 13.30

8 其他 - -

9 合计 1,752,602,977.62 100.00

注:因报告期末持有的部分基金占基金总资产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名的前十名资产支持证券投资明细

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 130301 中行转债 1,350,000 135,148,500.00 9.41

2 1182221 中行MTN1 1,000,000 103,720,000.00 7.22

3 122149 12亿元01 1,000,000 98,990,000.00 6.89

4 019302 13债02 700,000 69,790,000.00 4.86

5 1182246 11债新MTN1 500,000 53,765,000.00 3.74

注:因报告期末持有的部分基金占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资明细

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 000085 同仁堂 89,754,000.00 6.25

2 600597 光明乳业 40,522,373.84 2.80

3 4 应收股利 47,723,158.45 3.34

4 5 其他应收款 1,778,961.86 0.12

5 7 待摊费用 - -

6 8 其他 - -

7 9 合计 90,754,183.30 100.00

注:因报告期末持有的部分基金占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

5.8.4 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 135,148,500.00 9.41

2 110022 同仁转债 21,015,615.60 1.46

3 110007 博汇转债 18,766,800.00 1.31

4 110011 海药转债 8,793,000.00 0.61

5 110012 海药转债 7,251,212.20 0.50

6 110013 石化转债 104,811.00 0.01

注:因报告期末持有的部分基金占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

5.8.5 报告期末前十名股票投资情况说明

5.8.6 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

序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

1 本报告期期初基金份额总额 482,434,823.07 785,805,213.68

2 本报告期基金申购金额 68,088,496.69 95,946,719.73

3 本报告期基金赎回金额 75,238,443.06 705,141,390.19

4 本报告期基金拆分变动份额 - -

5 本报告期末基金份额总额 475,284,876.70 676,610,543.22

注:因报告期末持有的部分基金占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

§ 7 影响投资者决策的其他重要信息

§ 8 备查文件目录

1. 中国证监会批准本报告的文件;

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. 《基金章程》;

5. 《基金托管人报告》;

6. 《基金年度报告》;

7. 《基金半年度报告》;

8. 《基金季度报告》;

9. 《基金月度报告》;

10. 《基金公告》;

11. 《基金半年度报告摘要》;

12. 《基金季度报告摘要》;

13. 《基金月度报告摘要》;

14. 《基金半年度报告附注》;

15. 《基金季度报告附注》;

16. 《基金月度报告附注》;

17. 《基金半年度报告》;

18. 《基金季度报告》;

19. 《基金月度报告》;

20. 《基金半年度报告摘要》;

21. 《基金季度报告摘要》;

22. 《基金月度报告摘要》;

23. 《基金半年度报告附注》;

24. 《基金季度报告附注》;

25. 《基金月度报告附注》;

26. 《基金半年度报告》;

27. 《基金季度报告》;

28. 《基金月度报告》;

29. 《基金半年度报告摘要》;

30. 《基金季度报告摘要》;

31. 《基金月度报告摘要》;

32. 《基金半年度报告》;

33. 《基金季度报告》;

34. 《基金月度报告》;

35. 《基金半年度报告摘要》;

36. 《基金季度报告摘要》;

37. 《基金月度报告摘要》;

38. 《基金半年度报告》;

39. 《基金季度报告》;

40. 《基金月度报告》;

41. 《基金半年度报告摘要》;

42. 《基金季度报告摘要》;

43. 《基金月度报告摘要》;

44. 《基金半年