

工银瑞信14天理财债券型发起式证券投资基金

[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：工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一三年七月十八日

基金管理人的董事会及监事会在报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其实质性、准确性、完整性、及时性承担个别及连带责任。

基金合同由基金管理人和基金托管人根据法律法规规定，于2013年1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全部内容，保证不存在虚假记载、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。

基金资产的运作结果由投资者自行判断，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。

本基金中财基部资料未作更新。

本报机构自2013年1月1日起至6月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 工银14天理财债券发起

交易代码 485120

基金运作方式 约定开放式

基金合同生效日 2012年10月26日

报告期末基金份额总额 5,752,825,787.88份

投资目标 在控制风险并保持资产流动性的基础上，力争实现超过业绩比较基准的投资收益。

将采取利率策略、信用策略、相对价值策略等积极投资策略，在严格控制风险的前提下，发掘和利用市场失衡提供的投资机会，实现组合增值。

业绩比较基准 人民币七天通知存款利率后收益。

风险收益特征 本基金为债券型基金，预期收益和风险水平低于混合型基金、股票型基金，高于货币市场基金。

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

下属两级基金的基金简称 工银14天理财债券发起 A 工银14天理财债券发起 B

下属两级基金的交易代码 485120 485020

报告期末下属两级基金的份额总额 2,137,397,756.91份 3,615,428,036.97份

§ 3 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标 报告期(2013年4月1日 - 2013年6月30日)

工银14天理财债券发起 A 工银14天理财债券发起 B

1. 本期已实现收益 30,036,785.58 71,785,971.71

2. 本期利润 30,036,785.58 71,785,971.71

3. 期末基金资产净值 2,137,397,756.91 3,615,428,036.97

注：①本基金收益分配是按日结转份额。②以上数据未包含持有人认购或申购时垫付的费用，赎回时收取的费用，以及持有人赎回时支付的费用。

③上述基金收益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本期实现收益指基金本周期利息收入、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上一期公允价值变动收益，由于货币基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零。

⑤本基金合同生效日为2012年10月26日。

⑥本基金净值表现表

⑦净值收益率=净值/净值-1×100%⑧业绩比较基准收益=（1+业绩比较基准）^t-1⑨业绩比较基准收益率=业绩比较基准收益/业绩比较基准

⑩过去三个月 0.865% 0.001% 0.3366% 0.0000% 0.5293% 0.001%

⑪工银14天理财债券发起 A 净值收益率(%) 净值收益率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ⑪⑫⑬⑭

⑮过去三个月 0.9394% 0.0019% 0.3366% 0.0000% 0.6028% 0.0019%

注：①本基金收益分配是按日结转份额。②以上数据未包含持有人认购或申购时垫付的费用，赎回时收取的费用，以及持有人赎回时支付的费用。

③上述基金收益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本期实现收益指基金本周期利息收入、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上一期公允价值变动收益，由于货币基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零。

⑤本基金合同生效日为2012年10月26日。

⑥本基金净值表现表

⑦净值收益率=净值/净值-1×100%⑧业绩比较基准收益=（1+业绩比较基准）^t-1⑨业绩比较基准收益率=业绩比较基准收益/业绩比较基准

⑩工银14天理财债券发起 A 净值收益率(%) 净值收益率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ⑪⑫⑬⑭

⑮过去三个月 0.9394% 0.0019% 0.3366% 0.0000% 0.6028% 0.0019%

注：①本基金收益分配是按日结转份额。②以上数据未包含持有人认购或申购时垫付的费用，赎回时收取的费用，以及持有人赎回时支付的费用。

③上述基金收益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本期实现收益指基金本周期利息收入、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上一期公允价值变动收益，由于货币基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零。

⑤本基金合同生效日为2012年10月26日。

⑥本基金净值表现表

⑦净值收益率=净值/净值-1×100%⑧业绩比较基准收益=（1+业绩比较基准）^t-1⑨业绩比较基准收益率=业绩比较基准收益/业绩比较基准

⑩工银14天理财债券发起 A 净值收益率(%) 净值收益率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ⑪⑫⑬⑭

⑮过去三个月 0.9394% 0.0019% 0.3366% 0.0000% 0.6028% 0.0019%

注：①本基金收益分配是按日结转份额。②以上数据未包含持有人认购或申购时垫付的费用，赎回时收取的费用，以及持有人赎回时支付的费用。

③上述基金收益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本期实现收益指基金本周期利息收入、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上一期公允价值变动收益，由于货币基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零。

⑤本基金合同生效日为2012年10月26日。

⑥本基金净值表现表

⑦净值收益率=净值/净值-1×100%⑧业绩比较基准收益=（1+业绩比较基准）^t-1⑨业绩比较基准收益率=业绩比较基准收益/业绩比较基准

⑩工银14天理财债券发起 A 净值收益率(%) 净值收益率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ⑪⑫⑬⑭

⑮过去三个月 0.9394% 0.0019% 0.3366% 0.0000% 0.6028% 0.0019%

注：①本基金收益分配是按日结转份额。②以上数据未包含持有人认购或申购时垫付的费用，赎回时收取的费用，以及持有人赎回时支付的费用。

③上述基金收益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本期实现收益指基金本周期利息收入、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上一期公允价值变动收益，由于货币基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零。

⑤本基金合同生效日为2012年10月26日。

⑥本基金净值表现表

⑦净值收益率=净值/净值-1×100%⑧业绩比较基准收益=（1+业绩比较基准）^t-1⑨业绩比较基准收益率=业绩比较基准收益/业绩比较基准

⑩工银14天理财债券发起 A 净值收益率(%) 净值收益率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ⑪⑫⑬⑭

⑮过去三个月 0.9394% 0.0019% 0.3366% 0.0000% 0.6028% 0.0019%

注：①本基金收益分配是按日结转份额。②以上数据未包含持有人认购或申购时垫付的费用，赎回时收取的费用，以及持有人赎回时支付的费用。

③上述基金收益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本期实现收益指基金本周期利息收入、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上一期公允价值变动收益，由于货币基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零。

⑤本基金合同生效日为2012年10月26日。

⑥本基金净值表现表

⑦净值收益率=净值/净值-1×100%⑧业绩比较基准收益=（1+业绩比较基准）^t-1⑨业绩比较基准收益率=业绩比较基准收益/业绩比较基准

⑩工银14天理财债券发起 A 净值收益率(%) 净值收益率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ⑪⑫⑬⑭

⑮过去三个月 0.9394% 0.0019% 0.3366% 0.0000% 0.6028% 0.0019%

注：①本基金收益分配是按日结转份额。②以上数据未包含持有人认购或申购时垫付的费用，赎回时收取的费用，以及持有人赎回时支付的费用。

③上述基金收益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本期实现收益指基金本周期利息收入、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上一期公允价值变动收益，由于货币基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零。

⑤本基金合同生效日为2012年10月26日。

⑥本基金净值表现表

⑦净值收益率=净值/净值-1×100%⑧业绩比较基准收益=（1+业绩比较基准）^t-1⑨业绩比较基准收益率=业绩比较基准收益/业绩比较基准

⑩工银14天理财债券发起 A 净值收益率(%) 净值收益率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ⑪⑫⑬⑭

⑮过去三个月 0.9394% 0.0019% 0.3366% 0.0000% 0.6028% 0.0019%

注：①本基金收益分配是按日结转份额。②以上数据未包含持有人认购或申购时垫付的费用，赎回时收取的费用，以及持有人赎回时支付的费用。

③上述基金收益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本期实现收益指基金本周期利息收入、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上一期公允价值变动收益，由于货币基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零。

⑤本基金合同生效日为2012年10月26日。

⑥本基金净值表现表

⑦净值收益率=净值/净值-1×100%⑧业绩比较基准收益=（1+业绩比较基准）^t-1⑨业绩比较基准收益率=业绩比较基准收益/业绩比较基准

⑩工银14天理财债券发起 A 净值收益率(%) 净值收益率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ⑪⑫⑬⑭

⑮过去三个月 0.9394% 0.0019% 0.3366% 0.0000% 0.6028% 0.0019%

注：①本基金收益分配是按日结转份额。②以上数据未包含持有人认购或申购时垫付的费用，赎回时收取的费用，以及持有人赎回时支付的费用。

③上述基金收益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本期实现收益指基金本周期利息收入、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上一期公允价值变动收益，由于货币基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零。

⑤本基金合同生效日为2012年10月26日。

⑥本基金净值表现表

⑦净值收益率=净值/净值-1×100%⑧业绩比较基准收益=（1+业绩比较基准）^t-1⑨业绩比较基准收益率=业绩比较基准收益/业绩比较基准

⑩工银14天理财债券发起 A 净值收益率(%) 净值收益率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ⑪⑫⑬⑭

⑮过去三个月 0.9394% 0.0019% 0.3366% 0.0000% 0.6028% 0.0019%

注：①本基金收益分配是按日结转份额。②以上数据未包含持有人认购或申购时垫付的费用，赎回时收取的费用，以及持有人赎回时支付的费用。

③上述基金收益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本期实现收益指基金本周期利息收入、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上一期公允价值变动收益，由于货币基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零。

⑤本基金合同生效日为2012年10月26日。

⑥本基金净值表现表

⑦净值收益率=净值/净值-1×100%⑧业绩比较基准收益=（1+业绩比较基准）^t-1⑨业绩比较基准收益率=业绩比较基准收益/业绩比较基准

⑩工银14天理财债券发起 A 净值收益率(%) 净值收益率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ⑪⑫⑬⑭

⑮过去三个月 0.9394% 0.0019% 0.3366% 0.0000% 0.6028% 0.0019%

注：①本基金收益分配是按日结转份额。②以上数据未包含持有人认购或申购时垫付的费用，赎回时收取的费用，以及持有人赎回时支付的费用。

③上述基金收益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本期实现收益指基金本周期利息收入、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上一期公允价值变动收益，由于货币基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零。

⑤本基金合同生效日为2012年10月26日。

⑥本基金净值表现表

⑦净值收益率=净值/净值-1×100%⑧业绩比较基准收益=（1+业绩比较基准）^t-1⑨业绩比较基准收益率=业绩比较基准收益/业绩比较基准

⑩工银14天理财债券发起 A 净值收益率(%) 净值收益率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ⑪⑫⑬⑭

⑮过去三个月 0.9394% 0.0019% 0.3366% 0.0000% 0.6028% 0.0019%

注：①本基金收益分配是按日结转份额。②以上数据未包含持有人认购或申购时垫付的费用，赎回时收取的费用，以及持有人赎回