

基金管理人：工银瑞信基金管理有限公司  
基金托管人：中国农业银行股份有限公司  
送刊日期：2013年8月24日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事、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的法律责任。本基金年度报告经本公司内部审核委员会审定，于2013年7月12日复核了本报告中的财务数据、净值表现、收益分配政策等，并确认无误。本公司承诺将不向基金份额持有人进行虚假宣传和误导。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

本基金年度报告所载的半年度报告文本，投资者欲了解详细情况，应阅读半年度报告正文。

本报告期自2013年6月1日起至6月30日止。

## § 2 基金简介

**2.1 基金基本情况**

基金简称 工银信用纯债债券

基金主代码 485119

基金运作方式 约定开放式

基金合同生效日 2012年11月14日

基金管理人 工银瑞信基金管理有限公司

基金托管人 中国农业银行股份有限公司

报告期末基金份额总额 2,714,919,153.42份

基金合同存续期间 不定期

下属分级基金的基金简称：工银信用纯债债券A 工银信用纯债债券B

下属分级基金的交易代码：485119 485019

报告期末下属分级基金的份额总额 898,646,200.62份 1,816,272,952.80份

**2.2 基金概况说明**

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。

投资策略 本基金在充分考虑公司所处行业、企业规模、企业机构发行的固定收益类金融工具，在承担适度风险的前提下，从利率、信用等角度深入研究，充分挖掘信用货币市场的投资机会，优化组合，实现超出市场平均水平的投资收益。

业绩比较基准 基金业績比煩准確中債企业债总全价指数收益率×80%+中债国债总全价指数收益率×20%

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。根据《工银瑞信基金管理公司基金风险等级评价体系》，本基金的风险等级为中低风险。

风险收益特征 工银信用纯债债券A 工银信用纯债债券B

**2.3 基金管理人和基金托管人**

项目 基金管理人 基金托管人

名称 工银瑞信基金管理有限公司 中国农业银行股份有限公司

信息披露义务人 联系人 李芳菲

信息披露义务人联系电话 400-811-9999

信息披露义务人电子邮箱 customerservice@icbccs.com.cn

客户服务电话 400-811-9999

传真 95599

客户服务网址 www.icbccs.com.cn

**2.4 基金销售方式**

基金半年度报告备置地点 基金管理人和基金托管人的住所

**§ 3 主要财务指标和基金净值表现**

金额单位：人民币元

基金级别 工银信用纯债债券A 工银信用纯债债券B

报告期(2013年1月1日～2013年6月30日) 报告期(2013年1月1日～2013年6月30日)

本期已实现收益 27,741,825.97 52,426,094.54

本期利润 24,668,916.84 76,742,765.92

加权平均基金份额本期利润 0.0182 0.0289

本期基金份额净值增长率 3.19% 2.89%

报告期末基金份额净值增长率 3.19% 2.89%

报告期(2013年6月30日) 0.0256% 0.0226%

期末基金资产净值 930,920,732.40 1,876,080,234.99

期末基金份额净值 1.036 1.033

注：1.所列数据不包含持有人认购或申购基金时应付的费用，赎回时应付的费用不包含赎回费；所列数字为四舍五入后保留至小数点后两位。

2.本期基金资产净值变动比例=本期每份基金单位净值变动比例/本期每份基金单位净值。

3.本基金基金合同生效日为2012年1月14日。

4.本基金净值的表现与同期业绩比较基准收益率的比较

工银信用纯债债券A的净值增长率为3.19%，同期业绩比较基准收益率为2.89%；工银信用纯债债券B的净值增长率为2.89%，同期业绩比较基准收益率为2.89%。

5.阶段份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

过去一个月 -0.77% 0.21% -0.61% 0.18% -0.16% 0.03%

过去三个月 0.78% 0.14% 0.35% 0.12% 0.43% 0.02%

过去六个月 3.19% 0.11% 1.32% 0.09% 1.87% 0.02%

自基金合同生效起至今 3.60% 0.10% 0.91% 0.08% 2.39% 0.02%

6.阶段份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

过去一个月 -0.77% 0.21% -0.61% 0.18% -0.16% 0.03%

过去三个月 0.78% 0.14% 0.35% 0.12% 0.43% 0.02%

过去六个月 3.19% 0.11% 1.32% 0.09% 1.87% 0.02%

自基金合同生效起至今 3.60% 0.10% 0.91% 0.08% 2.39% 0.02%

7.阶段份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

过去一个月 -0.77% 0.21% -0.61% 0.18% -0.16% 0.03%

过去三个月 0.78% 0.14% 0.35% 0.12% 0.43% 0.02%

过去六个月 3.19% 0.11% 1.32% 0.09% 1.87% 0.02%

自基金合同生效起至今 3.60% 0.10% 0.91% 0.08% 2.39% 0.02%

8.阶段份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

过去一个月 -0.77% 0.21% -0.61% 0.18% -0.16% 0.03%

过去三个月 0.78% 0.14% 0.35% 0.12% 0.43% 0.02%

过去六个月 3.19% 0.11% 1.32% 0.09% 1.87% 0.02%

自基金合同生效起至今 3.60% 0.10% 0.91% 0.08% 2.39% 0.02%

9.阶段份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

过去一个月 -0.77% 0.21% -0.61% 0.18% -0.16% 0.03%

过去三个月 0.78% 0.14% 0.35% 0.12% 0.43% 0.02%

过去六个月 3.19% 0.11% 1.32% 0.09% 1.87% 0.02%

自基金合同生效起至今 3.60% 0.10% 0.91% 0.08% 2.39% 0.02%

10.阶段份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

过去一个月 -0.77% 0.21% -0.61% 0.18% -0.16% 0.03%

过去三个月 0.78% 0.14% 0.35% 0.12% 0.43% 0.02%

过去六个月 3.19% 0.11% 1.32% 0.09% 1.87% 0.02%

自基金合同生效起至今 3.60% 0.10% 0.91% 0.08% 2.39% 0.02%

11.阶段份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

过去一个月 -0.77% 0.21% -0.61% 0.18% -0.16% 0.03%

过去三个月 0.78% 0.14% 0.35% 0.12% 0.43% 0.02%

过去六个月 3.19% 0.11% 1.32% 0.09% 1.87% 0.02%

自基金合同生效起至今 3.60% 0.10% 0.91% 0.08% 2.39% 0.02%

12.阶段份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

过去一个月 -0.77% 0.21% -0.61% 0.18% -0.16% 0.03%

过去三个月 0.78% 0.14% 0.35% 0.12% 0.43% 0.02%

过去六个月 3.19% 0.11% 1.32% 0.09% 1.87% 0.02%

自基金合同生效起至今 3.60% 0.10% 0.91% 0.08% 2.39% 0.02%

13.阶段份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

过去一个月 -0.77% 0.21% -0.61% 0.18% -0.16% 0.03%

过去三个月 0.78% 0.14% 0.35% 0.12% 0.43% 0.02%

过去六个月 3.19% 0.11% 1.32% 0.09% 1.87% 0.02%

自基金合同生效起至今 3.60% 0.10% 0.91% 0.08% 2.39% 0.02%

14.阶段份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

过去一个月 -0.77% 0.21% -0.61% 0.18% -0.16% 0.03%

过去三个月 0.78% 0.14% 0.35% 0.12% 0.43% 0.02%

过去六个月 3.19% 0.11% 1.32% 0.09% 1.87% 0.02%

自基金合同生效起至今 3.60% 0.10% 0.91% 0.08% 2.39% 0.02%

15.阶段份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

过去一个月 -0.77% 0.21% -0.61% 0.18% -0.16% 0.03%

过去三个月 0.78% 0.14% 0.35% 0.12% 0.43% 0.02%

过去六个月 3.19% 0.11% 1.32% 0.09% 1.87% 0.02%

自基金合同生效起至今 3.60% 0.10% 0.91% 0.08% 2.39% 0.02%

16.阶段份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

过去一个月 -0.77% 0.21% -0.61% 0.18% -0.16% 0.03%

过去三个月 0.78% 0.14% 0.35% 0.12% 0.43% 0.02%

过去六个月 3.19% 0.11% 1.32% 0.09% 1.87% 0.02%

自基金合同生效起至今 3.60% 0.10% 0.91% 0.08% 2.39% 0.02%

17.阶段份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

过去一个月 -0.77% 0.21% -0.61% 0.18% -0.16% 0.03%

过去三个月 0.78% 0.14% 0.35% 0.12% 0.43% 0.02%

过去六个月 3.19% 0.11% 1.32% 0.09% 1.87% 0.02%

自基金合同生效起至今 3.60% 0.10% 0.91% 0.08% 2.39% 0.02%

18.阶段份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

过去一个月 -0.77% 0.21% -0.61% 0.18% -0.16% 0.03%

过去三个月 0.78% 0.14% 0.35% 0.12% 0.43% 0.02%

过去六个月 3.19% 0.11% 1.32% 0.09% 1.87% 0.02%

自基金合同生效起至今 3.60% 0.10% 0.91% 0.08% 2.39% 0.02%

19.阶段份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较