基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人:中国民生银行股份有限公司
送出日期:二〇一四年三月三十一日

工银瑞信添颐债券型证券投资基金

【2013】年度报告摘要

§1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年3月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告期自2013年01月01日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	工银添颐债券	
基金主代码	485114	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2011年8月10日	
基金管理人	工银瑞信基金管理有限公司	
基金托管人	中国民生银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	603,162,171.40份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	工银添颐债券A	工银添颐债券B
下属分级基金的交易代码:	485114	485014
报告期末下属分级基金的份额总额	224,511,838.59份	378,650,332.81份

2.2 基金产品说明

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,力争实现超越业绩比较基准的长期投资回报,为投资者提供养老投资的工具。
投资策略	本基金将在资产配置策略的基础上,通过固定收益类品种投资策略构筑债券组合的平稳收益,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。
业绩比较基准	五年期定期存款利率+1.5%
风险收益特征	本基金为债券型基金,预期收益和风险水平高于货币市场基金,低于混合型基金与股票型基金;因为本基金可以配置二级市场股票,所以预期收益和风险水平高于投资范围不含二级市场股票的债券型基金。

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	中国民生银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	朱碧艳	关悦
	联系电话	400-811-9999	010-58560666
	电子邮箱	customerservice@icbccs.com.cn	Guanyue2@cmbc.com.cn
客户服务电话		400-811-9999	95568
传真		010-66583158	010-58560794

2.4信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.icbccs.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2013年		2012年		2011年8月10日(基金合同生效日)-2011年12月31日	
	工银添颐债券A	工银添颐债券B	工银添颐债券A	工银添颐债券B	工银添颐债券A	工银添颐债券B
本期已实现收益	42,627,902.95	64,023,675.92	26,924,168.04	93,254,352.30	20,688,172.76	77,166,440.47
本期利润	16,559,637.35	22,381,317.08	35,563,312.66	105,164,274.92	22,517,722.33	92,613,670.84
加权平均基金份额净值利润	0.0384	0.0336	0.1437	0.1216	0.0520	0.0359
本期基金份额净值增长率	2.33%	1.60%	14.69%	13.98%	4.80%	4.40%
3.1.2 期末数据和指标	2013年末		2012年末		2011年末	
期末可供分配基金份额利润	0.2297	0.2091	0.1658	0.1540	0.0475	0.0442
期末基金资产净值	276,092,600.73	457,834,360.96	382,108,366.64	856,444,553.23	314,921,248.97	1,071,488,059.41
期末基金份额净值	1.230	1.209	1.202	1.190	1.048	1.044

注:1.所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.本基金基金合同生效日为2011年8月10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

工银添颐债券A

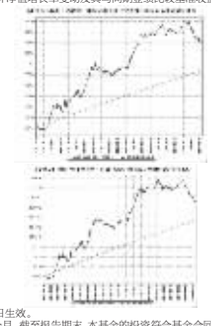
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-3.30%	0.18%	1.58%	0.02%	-4.88%	0.16%
过去六个月	-2.15%	0.17%	3.15%	0.02%	-5.30%	0.15%
过去一年	2.33%	0.22%	6.25%	0.02%	-3.92%	0.20%
自基金合同生效起至今	23.00%	0.27%	15.61%	0.02%	7.39%	0.25%

工银添颐债券B

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	-3.59%	0.18%	1.58%	0.02%	-5.17%	0.16%
过去六个月	-2.50%	0.17%	3.15%	0.02%	-5.65%	0.15%
过去一年	1.60%	0.22%	6.25%	0.02%	-4.65%	0.20%
自基金合同生效起至今	20.90%	0.27%	15.61%	0.02%	5.29%	0.25%

注:本基金基金合同生效日为2011年8月10日。

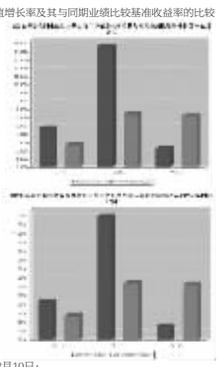
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1.本基金基金合同于2011年8月10日生效。

2.按基金合同规定,本基金建仓期为6个月。截至报告期末,本基金的投资符合基金合同的相关规定:本基金投资债券等固定收益类资产占基金资产的比例不低于80%;股票等权益类资产占基金资产的比例不超过20%,现金及到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于5%。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注:1.本基金基金合同于2011年8月10日;

2.合同生效当年按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自成立以来均未实施利润分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为工银瑞信基金管理有限公司,成立于2005年6月21日,是我国第一家由银行直接发起设立并控股的合资基金管理公司,注册资本为2亿元人民币,注册地在北京。公司目前拥有共同基金募集和管理资格、境外证券投资管理业务资格、企业年金基金投资管理人资格、特定客户资产管理业务资格、全国社保基金境内投资管理人资格。

截至2013年12月31日,公司旗下管理42只开放式基金——工银瑞信核心价值股票型证券投资基金、工银瑞信货币市场基金、工银瑞信精选平衡混合型证券投资基金、工银瑞信稳健成长股票型证券投资基金、工银瑞信增强收益债券型证券投资基金、工银瑞信红利股票型证券投资基金、工银瑞信中国机会全球配置股票证券投资基金、工银瑞信信用添利债券型证券投资基金、工银瑞信大盘蓝筹股票型证券投资基金、工银瑞信沪深300指数证券投资基金、上证中央企业50交易型开放式指数证券投资基金、工银瑞信中小盘成长股票型证券投资基金、工银瑞信全球精选股票型证券投资基金、工银瑞信双利债券型证券投资基金、深证红利交易型开放式指数证券投资基金、工银瑞信深证红利ETF联接基金、工银瑞信消费服务行业股票型证券投资基金、工银瑞信纯债债券型证券投资基金、工银瑞信添颐债券型证券投资基金、工银瑞信主题策略股票型证券投资基金、工银瑞信保本混合型证券投资基金、工银瑞信睿智中证500指数分级证券投资基金、工银瑞信基本面量化策略股票型证券投资基金、工银瑞信纯债定期开放债券型证券投资基金、工银瑞信7天理财债券型证券投资基金、工银瑞信睿智深证100指数分级证券投资基金、工银瑞信14天理财债券型发起式证券投资基金、工银瑞信信用纯债债券型证券投资基金、工银瑞信60天理财债券型证券投资基金、工银瑞信保本3号混合型发起式证券投资基金、工银瑞信增利分级债券型证券投资基金、工银瑞信安心增利场内实时申赎货币市场基金、工银瑞信产业债债券型证券投资基金、工银瑞信信用纯债一年定期开放债券型证券投资基金、工银瑞信信用纯债两年定期开放债券型证券投资基金、工银瑞信标普全球自然资源指数证券投资基金、工银瑞信保本3分混合型证券投资基金、工银瑞信月月薪定期支付债券型证券投资基金、工银瑞信金融地产行业股票型证券投资基金、工银瑞信双债增强债券型证券投资基金、工银瑞信添福债券型证券投资基金、工银瑞信信息产业股票型证券投资基金,证券投资基金管理规模逾1100亿元人民币。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杜海涛	固定收益投资总监、本基金的基金经理。	2011年8月10日	-	16	先后在宝盈基金管理有限公司担任基金经理助理、招商基金管理有限公司担任指商现金增值基金基金经理;2006年加入工银瑞信,现任固定收益投资总监;2006年9月21日至2011年4月21日,担任工银货币市场基金基金经理;2010年8月16日至2012年1月10日,担任工银双利债券型基金基金经理;2007年5月11日至今,担任工银增强收益债券型基金基金经理;2011年8月10日至今,担任工银瑞信添颐债券型证券投资基金基金经理;2012年6月21日至今,担任工银纯债定期开放基金基金经理;2013年1月7日至今,担任工银货币基金基金经理;2013年8月14日至今,担任工银月月薪定期支付债券型基金基金经理;2013年10月31日至今,担任工银添福债券基金基金经理。
宋炳坤	本基金的基金经理、研究部总监。	2012年2月14日	-	9	曾任中信建投证券有限公司研究员;2007年加入工银瑞信,现任研究部总监。2012年2月14日至今,担任工银瑞信添颐债券型证券投资基金基金经理;2013年1月28日至今,担任工银双利债券基金基金经理;2013年1月18日至今,担任工银双利债券基金基金经理;2013年1月28日至今,担任工银瑞信60天理财债券型基金基金经理。

注:1.任职日期说明:

1)杜海涛的任职日期为基金合同生效的日期

2)宋炳坤的任职日期为公司执委会决议日期

2.离任日期说明:无

3.证券从业年限的计算标准:证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定

4.本基金无基金经理助理

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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,无损害基金持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

1.公平交易原则

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,为公平对待不同基金份额持有人,公平对待基金持有人和其他资产委托人,在投资管理活动中公平对待公司所管理的不同基金财产和客户资产,不得直接或通过与第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。

2.适用范围

本制度适用于本公司所管理的不同投资组合,包括封闭式基金、开放式基金,以及社保组合、企业年金、特定客户资产管理组合等其他受托资产。基金经理,指管理公募基金基金经理,如封闭式基金、开放式基金。投资经理,指管理其他受托资产的投资经理,如企业年金、特定客户资产管理等专项受托资产。

3.公平交易的具体措施

3.1 在研究和投资决策环节:

3.1.1 在公司股票池的基础上,研究部根据不同投资组合的投资目标、投资风格、投资范围和关联交易限制等,参考公司《股票池管理办法》,建立股票池,各基金基金经理、其他受托资产投资经理在此基础上根据投资授权构建具体的投资组合。

3.1.2各基金基金经理、其他受托资产投资经理投资决策参照《投资授权管理办法》执行,在授权的范围内,独立、自主、审慎决策。

3.1.3 基金经理不得兼任投资经理,且各投资组合的基金经理、投资经理投资系统权限要严格分离。

3.1.4对于涉及到关联交易的投资行为,参考公司《关联交易管理制度》执行。

3.2在交易执行环节:

3.2.1交易人员、投资交易系统权限的适当分离。在必要的情况下,对于社保基金或其他专项受托资产组合配备专门的交易员,未经授权,其他交易员不得参与社保基金或其他专项受托资产组合的日常交易,并进行交易系统权限的屏蔽。

3.2.2公平交易执行原则:价格优先、时间优先、综合平衡、比例实施,保证交易在不同基金资产、不同受托资产间的公正,保证公司所管理的不同基金资产、受托资产间的利益公平。

3.2.3公平交易执行方法:

3.2.3.1 交易员必须严格按照"价格优先、时间优先"的交易执行原则,及时、迅速、准确地执行。

3.2.3.2在投资交易系统中设置"公平交易模块",对于涉及到同一证券品种的交易执行,系统自动通过公平交易模块完成。

公平交易模块执行原理如下:

1)同向交易指令:

a)限价指令:交易员采用投资交易系统中的公平委托系统,按照各组合委托数量设置委托比例,按比例具体执行;b)市价指令:对于市价同向交易指令,交易员首先应该按照"时间优先"的原则执行交易指令,并在接到启到达指令后按照先到指令剩余数量和新到指令数量采用公平委托系统执行;对于同时同向交易指令,交易员应采用投资交易系统中的公平委托模块,按照各基金委托数量设置委托比例,按比例具体执行;c)部分限价指令与部分市价指令:对于不同基金经理下达的不同类型的同向交易指令,交易员应该按照"价格优先"的原则进行交易指令,在市场价格未达到限价时,先执行市价指令,后执行限价指令;

2)反向交易指令

a)交易员不得接受可能导致同一投资组合或不同投资组合之间对敲的同一证券品种的指令,并由风险中台在投资系统中设置严禁所有产品在证券交易时对敲。b)根据证监会2011年修订的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》中相关条款,公司规定同一公募基金、年金、专户、社保组合或前述组合之间不允许同日针对同一证券的反向投资指令;c)同一公募基金不允许两日内针对同一证券的反向投资指令。d)确因投资组合要求的投资策略或流动性等需求而发生的同日反向交易,按要求投资组合经理要填写反向交易申请表,并要求相关投资经理提供决策依据,并保留记录备查。e)以上反向交易要求完全按照指数仿真组成进行投资的组合等除外。

3.2.4 对于银行间市场交易、交易所大宗交易、债券一级市场申购等非集中竞价交易,涉及到两个或以上基金或投资组合参与同一证券交易的情况,各基金/投资经理在交易前独立确定各投资组合的交易价格和数量,中央交易室按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配。参照《集中交易管理办法》,银行间市场债券买卖和回购交易,由交易填写《银行间市场交易审批单》,经相关基金经理/投资经理、交易主管审批,并由交易员双人复核后方可执行。公司对非公开发行股票申购,以公司名义进行的债券一级市场申购的申购方案和分配过程进行审核和监控,保证分配结果符合公平交易的原则。交易所大宗交易,填写《大宗交易申请表》,经公司主管领导、法律合规部审批后执行。债券一级市场交易,填写《债券投标审批表》及《债券分销审批表》,经公司主管领导、法律合规部审批后执行。其他非集中竞价交易,参考上述审批流程执行。

3.2.5 对于非公开发行股票申购,各基金/投资经理在申购前参照《投资流通受限证券工作流程》,独立确定申购价格和数量,中央交易室按照价格优先、比例分配的原则进行分配。

3.2.6 对于由于特殊原因不能参与公平交易程序的交易指令,中央交易室填写《公平交易审批单》,经公司主管领导、法律合规部及其公司主管领导审核批准后执行。对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易,各投资组合经理应在交易前独立确定各投资组合的交易价格和数量,有关申购方案和分配方案应报公司主管领导、法律合规部,以保证分配结果符合公平交易的原则。

3.2.7公平交易争议处理

在公平交易执行过程中若发生争议,或出现基金/投资经理对交易员执行公平交易结果不满情况,交易主管将具体情况报告公司主管领导,公司主管领导与相关基金/投资经理、交易主管就争议内容进行协调处理。

3.3公平交易的检查和价格监控

3.3.1 法律合规部可通过投资交易系统对于公平交易的执行情况进行稽核,并定期向督察长报告。如发现有疑问的交易情况,就交易时间、交易价格、交易数量、交易理由等提出疑问,由基金/投资经理作出合理解释。

3.3.2 风险管理部根据市场公认的第三方信息,对于投资组合与交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查,如发现异常情况的,基金/投资经理应对交易价格的异常情况进行合理性解释。

3.3.3 法律合规部应对不同投资组合在交易所公开竞价交易中同日同向交易的交易时机和交易价差进行监控,同时对不同投资组合临近交易日的同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行分析,如发现异常应向基金/投资经理提出,相关基金/投资经理应对异常交易情况进行合理性解释。风险管理部和法律合规部应对其他可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控,对于异常交易发生前后不同投资组合买卖该异常交易证券的情况进行分析。相关基金/投资经理应对异常交易情况进行合理性解释。

3.4 评估和分析

3.4.1风险管理部应分别于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别(股票、债券)的收益率差异进行分析,对连续四个季度期间内、不同时间窗下(如日内、3日内、5日内)公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析,由投资组合经理、督察长、总经理签署后,妥善保存分析报告备查。如果在上述分析期间内,公司管理的所有投资组合同向交易价差出现异常情况,应重新检查公司投资决策和交易执行环节的内部控制,针对潜在问题完善公平交易制度,进行专项说明,提交法律合规部、法律合规部应将此说明载入监察稽核季度报告和年度报告中对此做专项说明。

3.4.2中央交易室负责在各投资组合的定期报告中披露公司整体公平交易制度执行情况。法律合规部负责在各投资组合的定期报告中对异常交易行为进行专项说明,其中,如果报告期内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%,应说明该类交易的次数及原因。各投资组合的年度报告中,除上述内容外,还应披露公平交易制度和控制方法,并在公司整体公平交易制度执行情况中,对当年度同向交易价差做专项分析。其中,中央交易室负责公平交易制度的披露,法律合规部负责公平交易控制方法的披露,风险管理部负责按本制度3.4.1条的规定对公平交易制度执行情况中当年度同向交易价差的专项分析。

4.2报告

公司相关部门如果发现涉嫌违背公平交易原则的行为,应及时向公司管理层汇报并采取相关控制和改进措施。

4.3.2 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》、《基金管理公司特定客户资产管理业务试点办法》、《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,拟定了《公平交易管理办法》、《异常交易管理办法》,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。

公司于每季度和年度对公司管理的不同投资组合进行了同向交易价差分析,采用了日内、3日内、5日内的时间窗口,假设不同组合间价差为零,进行了1分布检验。对于没有通过检验的交易,公司根据交易价格、交易频率、交易数量、交易时间进行了具体分析。经分析,本报告期未出现公司管理的不同投资组合间有同向交易价差异常的情况。

4.3.3 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0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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

受益于货币环境的持续宽松和资产负债表的改善,发达国家在2013年持续改善。相比之下,包括中国在内的新兴市场国家受一系列结构性问题的困扰,经济出现了不同程度的下滑。在新兴市场需求下滑、供给释放、OE退出预期增强的背景下,大宗商品价格保持低位,除印度之外大部分国家的通胀压力都不大。具体到国内,财政政策和货币政策都有所收紧,基本面除了3季度在内外需的合力下有所反弹之外,全年都处于相对疲弱的态势。

1-5月初,在经济增速显著低于预期、外部流动性相对充裕的情况下,收益率持续下行,税收利差和信用利差都有所收窄。5月开始,央行采用正回购、发行央票等形式持续回收流动性,并且大幅抬高逆回购利率,导致回购利率中枢大幅上移。资金面收紧的同时,信托等非标准化债券产品挤占了银行、保险等机构配置额度,多方面的因素叠加导致债券市场出现了罕见的大幅下跌。股票和可转债在上半年受经济低迷的拖累,整体处于下跌态势;下半年经济出现了短暂反弹,再加上改革红利的逐步释放,两者较前期低点有所反弹。

工银添颐本报告期内根据宏观经济和通胀形势的变化,适时调整组合久期,改善信用债的结构,启期降低了可转债和股票的配置。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内,工银添颐A净值增长率为2.33%,工银添颐B净值增长率1.60%,比较基准收益率为6.25%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2014年全球经济可能出现明显分化:发达国家前期去杠杆程度较高,经济反弹的持续性较强;新兴市场国家的结构性问题依存,随着QE的逐步退出,大量资金撤出,增长前景尚不明朗。综合各个经济体的增长前景及其在中国出口中的占比,海外经济对中国产品的需求难以大幅增长,出口对国内经济的拉动力有限。对基建和房地产投资而言,融资环境大幅收紧对它们的负面影响正逐步发酵,国内经济面临一定的下行压力。物价在经济低迷、大宗商品价格低位徘徊的背景下压力有限。考虑到基本面重新走弱,再加上影子银行开始受到一定约束,货币政策在年内可能放松,但具体时点难以精确把握。

前期偏紧的资金面对企业的信用资质产生了一定的负面影响,再加上2季度以后是信托和低评级债券的到期高峰,信用风险可能进一步加大,国债等利率债的相对价值更高;可转债和股市受新股冲击、经济疲弱的影响,仍将以结构性行情为主。2014年,本基金将适时调整久期,继续改善信用债结构,在可转债和股票方面努力做好波段操作与结构调整。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

4.6.1参与估值流程各方及人员(或小组)的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历

4.6.1.1职责分工

参与估值小组成员为4人,分别是公司运作部负责人、研究部负责人、风险管理部负责人和法律合规部负责人,组长由运作部负责人担任。

各部门负责人也可推荐代表各部门参与估值小组的成员,如需更换,由相应部门负责人提出。小组成员需经运作部主管副总批准同意。

4.6.1.2专业胜任能力及相关工作经历

小组由具有多年从事估值运作、证券行业研究、风险管理及熟悉业内法律法规的专家型人员组成。

4.6.2 基金经理参与或决定估值的程度

本公司基金经理参与讨论估值原则及方法,但不参与最终估值决策。

4.6.3 参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4.6.4 已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度

尚无已签约的任何定价服务。本基金所采用的估值流程及估值结果均已经过会计师事务所鉴证,并经托管银行复核确认。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内,本基金未实施利润分配,符合相关法规及基金合同的规定。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

中国民生银行根据《工银瑞信添颐债券型证券投资基金基金合同》和《工银瑞信添颐债券型证券投资基金托管协议》,托管工银瑞信添颐债券型证券投资基金(以下简称"工银添颐债券基金")。

本年度,中国民生银行在工银添颐债券基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,依法安全保管了基金财产,按规定如实、独立地向中国证监会提交了本基金运作情况报告,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全履职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本年度,按照国家相关法律法规、基金合同、托管协议和其他有关规定,本托管人对基金管理人——工银瑞信基金管理有限公司在工银添颐债券基金投资运作方面进行了监督,对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金利润分配等方面进行了认真的复核,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。本年度,基金管理人——工银瑞信基金管理有限公司严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基合合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

由工银添颐债券基金管理人——工银瑞信基金管理有限公司编制,并经本托管人复核审查的本年度报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

§6 审计报告

本年度报告被出具了无保留意见的审计报告,且在审计报告中无强调事项,投资者欲了解详细内容,可阅读年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1资产负债表

会计主体:工银瑞信添颐债券型证券投资基金

报告截止日:2013年12月31日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
资 产:			
银行存款		9,634,153.38	12,215,661.42
结算备付金		6,804,196.00	12,566,266.40
存出保证金		704,997.03	250,000.00
交易性金融资产		1,125,243,810.01	2,124,600,843.36
其中:股票投资		30,791,404.10	175,643,782.30
基金投资		-	-
债券投资		1,094,452,405.91	1,948,957,061.06
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资			
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息		20,668,926.44	35,831,517.75
应收股利		-	-
应收申购款		1,150,842.38	1,621,765.76
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		1,164,206,925.24	2,187,086,054.69
负债和所有者权益	附注号	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		423,799,308.40	934,633,409.30
应付证券清算款		-	6,284,827.63
应付赎回款		3,486,110.39	4,058,961.78
应付管理人报酬		466,135.59	728,692.70
应付托管费		133,181.62	208,197.90
应付销售服务费		167,167.97	290,226.73
应付交易费用		372,304.23	471,180.05
应交税费		-	-
应付利息		282,315.33	1,208,647.38
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		1,573,440.02	648,991.35
负债合计		430,279,963.55	948,533,134.82
所有者权益:			
实收基金		603,162,171.40	1,037,873,109.24
未分配利润		130,764,790.29	200,679,810.63
所有者权益合计		733,926,961.69	1,238,552,919.87
负债和所有者权益总计		1,164,206,925.24	2,187,086,054.69

注:1.报告截止日2013年12月31日,基金份额总额为603,162,171.40份,其中A类基金份额净值为人民币1.230元,份额总额为224,511,838.59份;B类基金份额净值为人民币1.209元,份额总额为378,650,332.81份。

2.本基金基金合同生效日为2011年8月10日。

7.2 利润表

会计主体:工银瑞信添颐债券型证券投资基金

本报告期:2013年1月1日至2013年12月31日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
一.收入		85,288,364.92	185,954,261.89
1.利息收入		86,833,335.58	70,884,914.83
其中:存款利息收入		4,540,190.46	899,031.27
债券利息收入		81,870,817.56	69,946,095.59
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		422,327.56	39,787.97
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		64,544,233.30	93,441,578.73
其中:股票投资收益		47,745,682.49	34,301,787.49
基金投资收益		-	-
债券投资收益		16,162,476.39	57,829,263.32
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益			
衍生工具收益		-	-
股利收益		636,074.42	1,310,527.92
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		-67,710,624.44	20,549,067.24
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		1,621,420.48	1,078,701.09
减:二.费用		46,347,410.49	45,226,674.31
1.管理人报酬		9,604,865.41	8,797,221.88
2.托管费		2,744,247.28	2,513,491.96
3.销售服务费		3,316,954.05	3,903,395.11
4.交易费用		3,479,259.82	3,152,689.72
5.利息支出		26,745,173.21	26,414,582.52
其中:卖出回购金融资产支出		26,745,173.21	26,414,582.52
6.其他费用		456,910.72	445,293.12
三.利润总额(亏损总额以"-"号填列)		38,940,954.43	140,727,587.58
减:所得税费用		-	-
四.净利润(净亏损以"-"号填列)		38,940,954.43	140,727,587.58

注:本基金基金合同生效日为2011年8月10日。

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:工银瑞信添颐债券型证券投资基金

本报告期:2013年1月1日至2013年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一.期初所有者权益(基金净值)	1,037,873,109.24	200,679,810.63	1,238,552,919.87
二.本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	38,940,954.43	38,940,954.43
三.本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-434,710,937.84	-108,855,974.77	-543,566,912.61
其中:1.基金申购款	1,600,953,758.10	377,954,978.36	1,978,908,736.46
2.基金赎回款	-2,035,664,695.94	-486,810,953.13	-2,522,475,649.07
四.本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五.期末所有者权益(基金净值)	603,162,171.40	130,764,790.29	733,926,961.69
项目	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一.期初所有者权益(基金净值)	1,326,728,992.94	59,680,315.44	1,386,409,308.38
二.本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	140,727,587.58	140,727,587.58
三.本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-288,855,883.70	271,907.61	-288,583,976.09
其中:1.基金申购款	3,730,597,928.77	516,002,462.28	4,246,600,391.05
2.基金赎回款	-4,019,453,812.47	-515,730,554.67	-4,535,184,367.14
四.本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五.期末所有者权益(基金净值)	1,037,873,109.24	200,679,810.63	1,238,552,919.87

注:本基金基金合同生效日为2011年8月10日。

注:由于四舍五入的原因金额占基金资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

8.3 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

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600887	伊利股份	199,996	7,815,843.68	1.06
2	601299	中国北车	1,213,600	5,970,912.00	0.81
3	601318	中国平安	93,400	3,897,582.00	0.53
4	600292	中电远达	120,000	3,106,800.00	0.42
5	000413	宝 石A	102,574	1,736,577.82	0.24
6	600109	国金证券	98,300	1,668,151.00	0.23
7	300257	开山股份	43,300	1,667,483.00	0.23
8	600713	南京医药	300,000	1,584,000.00	0.22
9	600073	上海梅林	162,615	1,427,759.70	0.19
10	000712	锦龙股份	51,422	1,180,134.90	0.16

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于公司网站的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601166	兴业银行	36,812,189.79	2.97
2	601988	中国银行	29,