工银瑞信添福债券型证券投资基金

2018年第三季度报告

基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人:中国民生银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一八年十月二十五日

§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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年10月23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2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	工银添福债券	
交易代码	000184	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年10月31日	
报告期末基金份额总额	601,213,554.79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,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	本基金的投资风格以稳健为主,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。在债券资产的投资上,主要选择信用风险较低,到期收益率较高的债券进行投资配置;在股票资产的投资上,主要选择基本面良好、股息率较高且具备稳定分红历史的股票进行投资。	
业绩比较基准	人民币税后三年期银行定期存款利率+1.50%。三年期定期存款利率是指每年的第一个工作日中国人民银行网站上发布的三年期"金融机构人民币存款基准利率"。	
风险收益特征	本基金为债券型基金,预期风险与预期收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。	
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	
下属分级基金的基金简称	工银添福债券A	工银添福债券B
下属分级基金的交易代码	000184	000185
报告期末下属分级基金的份额总额	571,679,439.30份	29,534,115.49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(2018年7月1日 – 2018年9月30日)	
	工银添福债券A	工银添福债券B
1. 本期已实现收益	5,536,872.73	1,698,464.63
2. 本期利润	34,709,035.58	3,726,205.08
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0563	0.0808
4. 期末基金资产净值	943,749,650.48	48,607,594.82
5. 期末基金份额净值	1.651	1.646

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 本报告期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

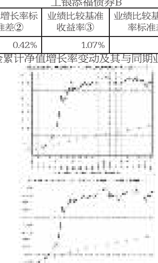
工银添福债券A

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	3.06%	0.38%	1.07%	0.01%	1.99%	0.37%

工银添福债券B

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	5.11%	0.42%	1.07%	0.01%	4.04%	0.41%

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



注:1、本基金基金合同于2013年10月31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,本基金的各项投资比例符合基金合同关于投资范围及投资限制的规定:债券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%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李昱	本基金的基金经理	2018年1月23日	–	11	曾先后在中投证券担任研究员,在华安基金担任高级研究员、小组负责人,在中信产业基金从事二级市场投研;2017年加入工银瑞信,现任固定收益部基金经理。2018年1月23日至今,担任工银瑞信添福债券型证券投资基金基金经理;2018年1月23日至今,担任工银瑞信新财富灵活配置混合型证券投资基金基金经理;2018年1月23日至今,担任工银瑞信新焦点灵活配置混合型证券投资基金基金经理;2018年2月23日至今,担任工银瑞信双债增强债券型证券投资基金(LOF)基金经理;2018年2月23日至今,担任工银瑞信新增益混合型证券投资基金基金经理;2018年2月23日至今,担任工银瑞信新生利混合型证券投资基金基金经理;2018年2月23日至今,担任工银瑞信新得润混合型证券投资基金基金经理;2018年3月6日至今,担任工银瑞信灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
张洋	本基金的基金经理	2018年8月28日	–	6	宾夕法尼亚大学电子工程专业博士,沃顿商学院统计学硕士;2012年加入工银瑞信,现任固定收益部基金经理,2015年8月17日至今,担任工银瑞信双债增强债券型证券投资基金(自2016年9月26日起,变更为工银瑞信双债增强债券型证券投资基金(LOF))基金经理;2015年8月17日至今,担任工银瑞信保本3号混合型证券投资基金基金经理;2016年11月22日至今,担任工银瑞信新得益混合型证券投资基金基金经理;2016年12月14日至今,担任工银瑞信可转债债券型证券投资基金基金经理;2016年12月29日至今,担任工银瑞信新增利混合型证券投资基金基金经理;2017年1月25日至2018年6月11日,担任工银瑞信瑞盈半年定期开放债券型证券投资基金基金经理;2018年7月2日至今,担任工银瑞信可转债优选债券型证券投资基金基金经理;2018年7月27日至今,担任工银瑞信新增益混合型证券投资基金基金经理;2018年7月27日至今,担任工银瑞信新得利混合型证券投资基金基金经理;2018年8月28日至今,担任工银瑞信添福债券型证券投资基金基金经理。
谷衡	固定收益部副总监,本基金的基金经理	2015年12月14日	2018年8月28日	13	先后在华夏银行总行担任交易员,在中信银行总行担任交易员;2012年加入工银瑞信,现任固定收益部副总监;2012年11月13日至今,担任工银瑞信14天理财债券型发起式证券投资基金;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;2014年9月30日至今,担任工银瑞信货币市场基金基金经理;2015年7月10日至2018年2月28日,担任工银瑞信财富快线货币市场基金基金经理;2015年12月14日至2018年8月28日,担任工银瑞信添福债券基金基金经理;2016年4月26日至2018年4月9日,担任工银瑞信安盈货币市场基金基金经理;2016年12月7日至2018年3月28日,担任工银瑞信丰益一年定期开放债券型证券投资基金基金经理;2017年2月28日至今,担任工银瑞信丰淳半年定期开放债券型证券投资基金(自2017年9月23日起,变更为工银瑞信丰淳半年定期开放债券型发起式证券投资基金)基金经理;2017年6月12日至今,担任工银瑞信丰实三年定期开放债券型证券投资基金基金经理;2017年12月26日至今,担任工银瑞信尊享纯债债券型证券投资基金基金经理;2018年2月28日至今,担任工银瑞信信用添利债券型证券投资基金基金经理;2018年6月15日,担任工银瑞信瑞祥定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。
杜海涛	副总经理,本基金的基金经理	2013年10月31日	2018年8月28日	21	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招商现金增值基金基金经理;2006年加入工银瑞信,现任公司副总经理,兼任子公司-工银瑞信资产管理(国际)有限公司董事;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;2012年6月21日至2017年7月19日,担任工银纯债定期开放基金基金经理;2013年8月14日至2015年11月11日,担任工银月月薪定期支付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;2013年1月7日至今,担任工银货币市场基金基金经理;2013年10月31日至2018年8月28日,担任工银瑞信添福债券基金基金经理;2014年1月27日至2018年6月5日,担任工银薪金货币市场基金基金经理;2015年4月17日至2018年6月5日,担任工银总回报灵活配置混合型基金基金经理;2018年2月27日至今,担任工银瑞信信用添利债券型证券投资基金基金经理。

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》、《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。

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未超过该证券当日成交量的5%。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2018年三季度全球经济不确定继续加大,美联储加息,货币政策收紧叠加美国政府开启"贸易战",对于全球风险偏好造成极大影响,带动全球权益资产出现回调。

考虑到国际宏观环境中有变的情况,国内政策层面对于经济的支持力度加强,货币政策和财政政策双管齐下,减税降费措施频出。在此背景下,国内债券市场三季度震荡。而股票市场受全球风险偏好调整影响波动性加大,但由于国内基本面和企业盈利稳定,在政策支持下回调中存在机会。

本基金在报告期内根据对于市场变化的判断积极调整仓位,同时积极参与新发可转债申购;权益仓位维持中性,重点配置价值低估的保险行业。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内,工银添福债券A份额净值增长率为3.06%,工银添福债券B份额净值增长率为5.11%,业绩比较基准收益率为1.07%。

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	141,296,387.06	12.78
	其中:股票	141,296,387.06	12.78
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	938,414,962.94	84.88
	其中:债券	938,414,962.94	84.88
	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	800,000.00	0.07
	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	13,089,710.95	1.18
8	其他资产	11,969,355.07	1.08
9	合计	1,105,570,416.02	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

代码	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	20,740,406.40	2.09
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	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	–	–
J	金融业	115,956,937.66	11.68
K	房地产业	4,599,043.00	0.46
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	–	–
	合计	141,296,387.06	14.24

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。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.3 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

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	601336	新华保险	1,627,271	82,144,640.08	8.28
2	601318	中国平安	240,119	16,448,151.50	1.66
3	601601	中国太保	350,000	12,428,500.00	1.25
4	601222	林洋能源	1,742,530	8,155,040.40	0.82
5	600271	航天信息	203,000	5,649,490.00	0.57
6	000768	中航飞机	313,700	4,981,556.00	0.50
7	002142	宁波银行	277,908	4,935,646.08	0.50
8	600048	保利地产	377,900	4,599,043.00	0.46
9	002415	海康威视	68,000	1,954,320.00	0.20

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	–	–
2	央行票据	–	–
3	金融债券	50,300,000.00	5.07
	其中:政策性金融债	50,300,000.00	5.07
4	企业债券	407,617,607.20	41.08
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	111,762,000.00	11.26
7	可转债(可交换债)	368,735,355.74	37.16
8	同业存单	–	–
9	其他	–	–
10	合计	938,414,962.94	94.56

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	132004	15国盛EB	810,040	76,953,800.00	7.75
2	128024	宁行转债	570,392	64,779,419.44	6.53
3	132012	17巨化EB	521,260	50,770,724.00	5.12
4	136833	G17三峡1	500,000	50,520,000.00	5.09
5	018005	国开1701	500,000	50,300,000.00	5.07

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国债期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.9.3 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。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	143,666.71
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	10,467,206.11
5	应收申购款	1,358,482.25
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	11,969,355.07

5.10.4 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	132004	15国盛EB	76,953,800.00	7.75
2	128024	宁行转债	64,779,419.44	6.53
3	132012	17巨化EB	50,770,724.00	5.12
4	132006	16皖新EB	37,098,898.20	3.74
5	113008	电气转债	33,510,261.60	3.38
6	132005	15国资EB	33,202,100.00	3.35
7	113014	林洋转债	12,796,084.80	1.29
8	123006	东财转债	8,504,943.30	0.86
9	132007	16凤凰EB	7,153,650.00	0.72
10	128035	大族转债	6,588,266.40	0.66
11	113011	光大转债	5,420,167.20	0.55
12	110032	三一转债	5,077,200.00	0.51

注:上表包含期末持有的处于转股期的可转换债券和可交换债券明细。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

5.10.6 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

项目	工银添福债券A	工银添福债券B
报告期期初基金份额总额	746,499,804.31	28,430,418.92
报告期期间基金总申购份额	1,109,243.93	128,712,644.12
减:报告期期间基金总赎回份额	175,929,608.94	127,608,947.55
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	571,679,439.30	29,534,115.49

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。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 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	13,163,404.54
报告期期间买入/申购总份额	0.00
报告期期间卖出/赎回总份额	0.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	13,163,404.54
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	2.19

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20180701-20180723	170,333,136.44	0.00	170,333,136.44	0.00	0.00%
	2	20180701-20180930	477,015,353.27	0.00	0.00	477,015,353.27	79.34%
个人	–	–	–	–	–	–	–
产品特有风险							
本基金份额持有人较为集中,存在基金规模大幅波动的风险,以及由此导致基金收益较大波动的风险。							

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

自2018年8月28日起,张洋先生担任工银瑞信添福债券型证券投资基金的基金经理,杜海涛先生、谷衡先生不再担任工银瑞信添福债券型证券投资基金的基金经理,详见基金管理人在指定媒介发布的公告。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准工银瑞信添福债券型证券投资基金设立的文件;
2、《工银瑞信添福债券型证券投资基金基金合同》;
3、《工银瑞信添福债券型证券投资基金托管协议》;
4、基金管理人业务资格批件和营业执照;
5、基金托管人业务资格批件和营业执照;
6、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

9.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的住所。

9.3 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。

工银瑞信添祥一年定期开放债券型证券投资基金

2018年第三季度报告

基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人:中国邮政储蓄银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一八年十月二十五日

§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。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年10月23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2018年7月25日(基金合同生效日)起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	工银添祥一年定开债券
交易代码	006004
基金运作方式	契约型、定期开放式
基金合同生效日	2018年7月25日
报告期末基金份额总额	1,298,564,075.67份
投资目标	在严格控制风险的基础上,合理配置股债比例、精选个券,追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	封闭期内,本基金将由投资研究团队及时跟踪市场环境变化,根据对国内宏观经济运行态势、宏观经济政策变化、证券市场运行状况等因素的深入研究,判断证券市场的发展趋势,结合流动性、估值水平、风险偏好等因素,综合评价各类资产的风险收益水平。在充分的宏观形势判断和策略分析的基础上,通过"自上而下"的资产配置及动态调整策略,将基金资产在股票、可转债、普通债券和现金等资产间进行配置并动态调整比例。对于债券投资,在利率预期分析及其久期配置范围确定的基础上,通过情景分析和历史预测相结合的方法,"自上而下"在信用债、政府债券等资产类别之间进行类属配置,进而确定具有最优风险收益特征的资产组合。 开放期内,本基金为保持较高的组合流动性,方便投资人安排投资,在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下,将主要投资于高流动性的投资品种,减小基金净值的波动。
业绩比较基准	90%×中债信用债总财富指数收益率+10%×沪深300指数收益率。
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股票型基金及混合型基金,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	中国邮政储蓄银行股份有限公司

§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(2018年7月25日 – 2018年9月30日)
1.本期已实现收益	7,125,188.15
2.本期利润	548,990.24
3.加权平均基金份额本期利润	0.0004
4.期末基金资产净值	1,299,113,065.91
5.期末基金份额净值	1.0004

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 本报告期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

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	0.04%	0.05%	0.64%	0.13%	-0.60%	-0.08%

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

注:1、本基金基金合同于2018年7月25日生效。截至报告期末,本基金尚处于建仓期。

2、根据基金合同规定,本基金建仓期为6个月。建仓期满,本基金的各项投资比例应符合基金合同关于投资范围及投资限制的规定:本基金对债券的投资比例不低于基金资产的80%,投资于股票、权证等权益类资产的比例不高于基金资产的20%。但为开放期流动性需要,保护基金份额持有人利益,在每次开放期开始前一个月、开放期及开放期结束后一个月的期间内,基金投资不受上述比例限制。开放期内,每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后,本基金所持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%;在封闭期内,本基金不受该比例的限制,但每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于交易保证金一倍的现金;前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
何秀红	固定收益部副总监,本基金的基金经理	2018年7月25日	–	11	曾任广发证券股份有限公司债券研究员;2009年加入工银瑞信,现任固定收益部副总监;2011年2月10日至今,担任工银四季收益债券型基金基金经理;2011年12月27日至2015年1月19日,担任工银保本混合基金基金经理;2012年11月14日至今,担任工银信用纯债债券基金基金经理;2013年3月29日至今,担任工银瑞信产业债债券基金基金经理;2013年5月22日至今,担任工银信用纯债一年定期开放基金基金经理;2013年6月24日起至2018年2月23日,担任工银信用纯债两年定期开放基金基金经理;2015年10月27日起至今,担任工银丰收回报灵活配置混合型基金基金经理;2016年9月12日起至今,担任工银瑞信瑞享纯债债券型证券投资基金基金经理;2018年7月25日起至今,担任工银瑞信添祥一年定期开放债券型证券投资基金;2018年7月27日至今,担任工银瑞信银和利混合型证券投资基金基金经理。

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》、《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。

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未超过该证券当日成交量的5%。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

海外方面,三季度发达国家经济延续放缓态势,主要源于欧洲景气度继续下滑。美国方面,受美联储表态偏鸽派影响,美元指数转为震荡,人民币贬值压力稍有缓解,9月美联储如期加息25bp。中美贸易摩擦明显升级,对全球资本市场风险偏好扰动加剧,对国内就业与需求的负面影响也开始显现。国内方面,基本面进一步放缓,基建投资持续下滑,带动固定资产投资增速创历史新低,不过地产投资维持高位、制造业投资继续改善,为经济提供一定韧性。往后看,四季度基建投资大概率企稳,但受外需放缓叠加贸易摩擦加剧影响,出口或明显走弱,成为需求端的主要拖累,经济下行压力增大,结合通胀小幅上行的判断,需警惕阶段性滞胀风险。流动性方面,三季度货币政策维持宽松,资金利率中枢明显下移。市场方面,尽管流动性延续宽松格局,经济弱势显现,但7月政治局会议调整政策基调、明确稳增长诉求,引发市场对宽信用带动经济改善的预期,债市收益率小幅调整,10年期国债收益率季末较7月中旬低点上行近17bp,10年期国开收益率上行约15bp,信用利差走势震荡、整体持平。转债市场三季度企稳反弹,主要源于权重个券贡献较多,在债市整体表现突出的背景下,受益于债底的提升,转债表现强于股市。

工银添祥一年定开债券基金本报告期内完成建仓,以高等级短期限信用债为主要持仓。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内,本基金净值增长率为0.04%,业绩比较基准收益率为0.64%。

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	–	–
3	固定收益投资	1,910,271,181.59	98.09
	其中:债券	1,716,160,781.59	88.12
	资产支持证券	194,110,400.00	9.97
4	贵金属投资	–	–
5	金融衍生品投资	–	–
6	买入返售金融资产	–	–
	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	19,672,586.52	1.01
8	其他资产	17,596,349.04	0.90
9	合计	1,947,540,117.15	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 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	–	–
2	央行票据	–	–
3	金融债券	–	–
	其中:政策性金融债	–	–
4	企业债券	1,380,466,607.29	106.26
5	企业短期融资券	230,309,000.00	17.73
6	中期票据	80,405,000.00	6.19
7	可转债(可交换债)	24,980,174.30	1.92
8	同业存单	–	–
9	其他	–	–
10	合计	1,716,160,781.59	132.10

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	041800314	18云能投CP003	600,000	60,066,000.00	4.62
2	1780211	17厦门轨道债02	500,000	50,385,000.00	3.88
3	101651057	16苏国信MTN002	500,000	50,015,000.00	3.85
4	143758	18CHNG1D	500,000	49,930,000.00	3.84
5	112425	16河钢02	500,000	49,675,000.00	3.82

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

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	149787	18花呗5A	800,000	80,000,000.00	6.16
2	139056	链融2A1	200,000	20,030,000.00	1.54
2	139059	万科22A1	200,000	20,030,000.00	1.54
4	139061	恒融二5B	200,000	20,024,000.00	1.54
5	139060	恒融二5A	100,000	10,013,000.00	0.77
6	139091	链融3A1	100,000	10,009,000.00	0.77
7	149851	中铝租01	100,000	10,000,000.00	0.77
7	139107	龙腾优01	100,000	10,000,000.00	0.77
7	139121	龙腾优03	100,000	10,000,000.00	0.77
10	139070	万科优10	40,000	4,004,400.00	0.31

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国债期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.9.3 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。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	140,004.14
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	17,456,344.90
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	17,596,349.04

5.10.4 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	132008	17山高EB	12,976,425.00	1.00
2	132007	16凤凰EB	6,615,000.00	0.51
3	132004	15国盛EB	5,225,000.00	0.40

注:上表包含期末持有的处于转股期的可转换债券和可交换债券明细。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

5.10.6 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

基金合同生效日(2018年7月25日)基金份额总额	1,298,564,075.67
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	–
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	–
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	–
报告期期末基金份额总额	1,298,564,075.67

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。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会准予工银瑞信添祥一年定期开放债券型证券投资基金募集申请的注册文件;

2、《工银瑞信添祥一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》;

3、《工银瑞信添祥一年定期开放债券型证券投资基金托管协议》;

4、基金管理人业务资格批件、营业执照;

5、基金托管人业务资格批件、营业执照;

6、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

9.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的住所。

9.3 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。

工银瑞信添颐债券型证券投资基金

2018年第三季度报告

基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人:中国民生银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一八年十月二十五日

§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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年10月23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2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	工银添颐债券	
交易代码	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	
报告期末基金份额总额	337,773,026.05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,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。	
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	
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	123,783,363.37份	213,989,662.68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(2018年7月1日 – 2018年9月30日)	
	工银添颐债券A	工银添颐债券B
1. 本期已实现收益	-1,045,098.24	-2,071,962.70
2. 本期利润	11,081,487.13	20,407,652.34
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0861	0.0776
4. 期末基金资产净值	249,489,181.71	411,209,197.41
5. 期末基金份额净值	2.016	1.922

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 本报告期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

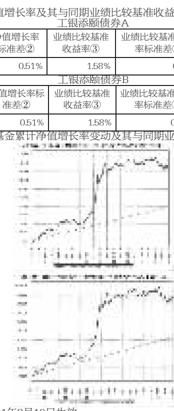
工银添颐债券A

阶段	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	4.46%	0.51%	1.58%	0.01%	2.88%	0.50%

工银添颐债券B

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	4.40%	0.51%	1.58%	0.01%	2.82%	0.50%

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



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。截至本报告期末,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%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杜海涛	副总经理,本基金的基金经理	2011年8月10日	–	21	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招商现金增值基金基金经理;2006年加入工银瑞信,现任公司副总经理,兼任子公司-工银瑞信资产管理(国际)有限公司董事;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;2012年6月21日至2017年7月19日,担任工银纯债定期开放基金基金经理;2013年8月14日至2015年11月11日,担任工银月月薪定期支付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;2013年1月7日至今,担任工银货币市场基金基金经理;2013年10月31日至2018年8月28日,担任工银瑞信添福债券基金基金经理;2014年1月27日至2018年6月5日,担任工银薪金货币市场基金基金经理;2015年4月17日至2018年6月5日,担任工银总回报灵活配置混合型基金基金经理;2018年2月27日至今,担任工银瑞信信用添利债券型证券投资基金基金经理。
宋炳珅	权益投资总监,本基金的基金经理	2012年2月14日	–	14	曾任中信建投证券有限公司研究员;2007年加入工银瑞信,现任权益投资总监。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2014年12月5日,担任工银瑞信60天理财债券型基金基金经理;2014年1月20日至2018年8月28日,担任工银瑞信红利混合型证券投资基金基金经理;2014年1月20日至2017年5月27日,担任工银瑞信核心价值混合型证券投资基金基金经理;2014年10月23日至今,担任工银瑞信研究精选股票型基金基金经理;2014年11月18日至2018年8月28日,担任工银医疗保健行业股票型基金基金经理;2015年2月16日至2017年12月22日,担任工银战略转型主题股票基金基金经理;2017年4月12日至今,担任工银瑞信中国制造2025股票型证券投资基金基金经理。

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》、《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。

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未超过该证券当日成交量的5%。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

三季度,国内经济延续今年以来的下行态势,但幅度仍然比较温和,此前偏紧的宏观政策对于经济的下行压力持续在体现。全球范围内来看,经济的分化程度进一步加大,美国经济继续上行,劳动力市场边际收紧,失业率降至20世纪70年代以来的新低水平,但是非美经济体表现整体较弱,个别新兴经济体例如土耳其出现货币危机,凸显全球经济发展的不平衡性。政策层面,中央出台一系列措施,意在稳定实体流动性的增长,避免上半年信用紧缩局面的再现。

债券方面,收益率曲线大幅陡峭化,1年期国债到期收益率由二季度末的3.16%下行至三季度末的2.97%,10年期国债到期收益率由二季度末的3.48%上行至三季度末的3.61%,收益率曲线的陡峭化程度上升到近几年的较高水平。流动性的持续宽松和违约风险的下降,使得风险偏好有所回升,三季度信用债表现好于利率债,信用利差压缩明显,中低等级信用债整体表现好于高等级信用债,转债类资产明显上涨。但是在外部贸易摩擦风险高企的背景下,流动性宽松对于股票市场利好有限,三季度股票市场继续下跌,整体估值水平已经处于历史上的较低水平,反映了市场投资者对于中国经济基本面较为悲观的预期。

报告期内本基金根据宏观经济和通胀形势的变化,提升了杠杆水平,维持久期水平和权益资产仓位基本不变。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内,工银添颐债券A份额净值增长率为4.46%,工银添颐债券B份额净值增长率为4.40%,业绩比较基准收益率为1.58%。

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	130,701,733.91	14.81
	其中:股票	130,701,733.91	14.81
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	726,105,998.90	82.25
	其中:债券	726,105,998.90	82.25
	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	–	–
	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	14,025,253.40	1.59
8	其他资产	11,926,793.93	1.35
9	合计	882,759,780.14	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

代码	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	13,432,284.15	2.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	–	–
E	建筑业	1,312,000.00	0.20
F	批发和零售业	–	–
G	交通运输、仓储和邮政业	–	–
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,700,000.00	0.41
J	金融业	111,048,579.76	16.81
K	房地产业	2,208,870.00	0.33
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	–	–
	合计	130,701,733.91	19.78

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。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.3 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

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	601336	新华保险	1,030,687	52,029,079.76	7.87
2	601318	中国平安	400,000	27,400,000.00	4.15
3	601601	中国太保	450,000	15,979,500.00	2.42
4	601818	光大银行	4,000,000	15,640,000.00	2.37
5	603960	克来机电	324,805	9,104,284.15	1.38
6	300114	中航电测	400,000	4,328,000.00	0.66
7	300059	东方财富	240,000	2,700,000.00	0.41
8	000002	万科A	90,900	2,208,870.00	0.33
9	002051	中工国际	100,000	1,312,000.00	0.20

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	–	–
2	央行票据	–	–
3	金融债券	40,028,000.00	6.06
	其中:政策性金融债	40,028,000.00	6.06
4	企业债券	136,757,905.00	20.70
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	153,373,000.00	23.21
7	可转债(可交换债)	346,326,093.90	52.42
8	同业存单	–	–
9	地方政府债	49,621,000.00	7.51
10	其他	–	–
11	合计	726,105,998.90	109.90

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	136047	15国君G1	600,000	60,000,000.00	9.08
2	128024	宁行转债	520,067	59,064,009.19	8.94
3	132004	15国盛EB	427,350	40,598,250.00	6.14
4	170211	17国开11	400,000	40,028,000.00	6.06
5	113008	电气转债	373,240	37,756,958.40	5.71

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国债期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.9.3 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。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	48,191.23
2	应收证券清算款	277,686.65
3	应收股利	–
4	应收利息	11,041,467.73
5	应收申购款	559,448.32
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	11,926,793.93

5.10.4 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	128024	宁行转债	59,064,009.19	8.94
2	132004	15国盛EB	40,598,250.00	6.14
3	113008	电气转债	37,756,958.40	5.71
4	113014	林洋转债	36,519,410.40	5.53
5	110032	三一转债	32,339,225.40	4.89
6	132007	16凤凰EB	26,460,000.00	4.00
7	123006	东财转债	17,869,950.00	2.70
8	132005	15国资EB	14,287,207.10	2.16
9	113011	光大转债	12,969,608.40	1.96
10	132012	17巨化EB	10,113,042.00	1.53
11	128021	兄弟转债	7,815,668.20	1.18
12	128023	亚太转债	6,428,687.79	0.97
13	132011	17浙报EB	6,298,600.00	0.95
14	128035	大族转债	4,430,214.00	0.67
15	132006	16皖新EB	4,239,673.10	0.64
16	128018	时达转债	3,050,713.12	0.46
17	120001	16以岭EB	664,876.80	0.10

注:上表包含期末持有的处于转股期的可转换债券和可交换债券明细。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

5.10.6 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

项目	工银添颐债券A	工银添颐债券B
报告期期初基金份额总额	135,124,580.47	282,466,818.99
报告期期间基金总申购份额	2,232,854.35	37,851,052.42
减:报告期期间基金总赎回份额	13,574,071.45	106,328,208.73
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	123,783,363.37	213,989,662.68

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。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 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	20,507,779.79
报告期期间买入/申购总份额	0.00
报告期期间卖出/赎回总份额	10,090,817.36
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,416,962.43
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	3.08

注:报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额;
报告期期间基金总赎回份额含转换出份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	基金转换出	2018年8月6日	10,090,817.36	18,929,373.37	0.00%
合计			10,090,817.36	18,929,373.37	

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准工银瑞信添颐债券型证券投资基金设立的文件;
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、基金管理人业务资格批件和营业执照;
5、基金托管人业务资格批件和营业执照;
6、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

9.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的住所。

9.3 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。