# 工银瑞信红利混合型证券投资基金

## 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：中国建设银行股份有限公司
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。

基金托管人中国建设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 | 工银红利混合 |
| 交易代码 | 481006 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2007年7月18日 |
| 报告期末基金份额总额 | 609,568,439.38份 |
| 投资目标 | 在合理控制风险的基础上，追求基金资产的长期稳定增值，获得超过业绩比较基准的投资业绩。 |
| 投资策略 | 本基金采用定量和定性相结合的个股精选策略，通过红利股筛选、竞争优势评价和盈利预测的选股流程，精选出兼具稳定的高分红能力、较强竞争优势和持续盈利增长的上市公司股票作为主要投资对象，以增强本基金的股息收益和资本增值能力。 |
| 业绩比较基准 | 85%×中证红利指数收益率+15%×中债综合财富（总值）指数收益率。 |
| 风险收益特征 | 本基金属于混合型基金中的红利主题型基金，其风险与预期收益高于货币型基金和债券型基金，低于股票型基金。 |
| 基金管理人 | 工银瑞信基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国建设银行股份有限公司 |

§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1日 － 2018年9月30日） |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | -23,776,303.25 |
| 2.本期利润 | -16,229,993.83 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0265 |
| 4.期末基金资产净值 | 480,867,299.56 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.7889 |

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。

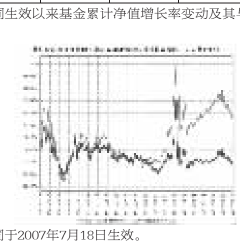
3、所列数据截止到报告期最后一日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

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 | -3.24% | 1.28% | -1.32% | 0.98% | -1.92% | 0.30% |

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、本基金合同于2007年7月18日生效。

2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效起六个月内为建仓期。截至本报告期末，本基金的各项投资比例已达到基金合同关于投资范围及投资限制的规定：本基金投资股票等权益类资产占基金资产的比例为60%－95%，现金、债券资产、权证以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为5%－40%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等，权证投资占基金资产净值的比例不超过3%。

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 | | |
| 林念 | 本基金基金经理 | 2016年9月27日 | - | 5 | 北京大学宏观经济学博士；曾在光大证券股份有限公司担任宏观分析师；2014年加入工银瑞信基金管理有限公司，现任研究部宏观策略研究团队负责人、基金经理。2016年9月27日至今，担任工银瑞信红利混合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 | 2014年1月20日 | 2018年8月28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A股市场整体延续弱势，主板表现好于中小创。二季度明显下跌的创业板50指数在三季度跌幅仍逾13%，与之相对，上证50指数同期则上涨约5%。

分行业而言，中信一级行业指数中，银行、石油石化、非银金融、钢铁、国防军工和建筑指数收涨，其中，银行和石油石化涨幅超过10%，而家电、纺织服装、电子、医药、传媒轻工制造以及有色金属跌幅均超过10%。在此期间，本基金坚持自上而下和自下而上相结合的投资策略。行业配置方面，基金组合在非银金融、国防军工有所超配，不过幅度有限，同时基金组合在偏成长类股票上还维持了一定的正风险暴露，后者加大了组合净值表现相对基准的波动幅度。虽然基金管理人根据市场变化对组合做了一些调整，但就三季度而言，还是出现一定幅度的下跌。

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-3.24%，业绩比较基准收益率为-1.32%。

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 | 441,466,505.34 | 91.44 |
| | 其中：股票 | 441,466,505.34 | 91.44 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中：债券 | - | - |
| | 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 | 41,177,744.54 | 8.53 |
| 8 | 其他资产 | 152,415.72 | 0.03 |
| 9 | 合计 | 482,796,665.60 | 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 | 2,165,228.00 | 0.45 |
| C | 制造业 | 206,403,475.38 | 42.92 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 43,138,119.30 | 8.97 |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | 12,787,268.11 | 2.66 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 16,997,970.84 | 3.53 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 18,782,218.30 | 3.91 |
| J | 金融业 | 91,158,920.00 | 18.96 |
| K | 房地产业 | 38,132,749.21 | 7.93 |
| L | 租赁和商务服务业 | 9,462,511.20 | 1.97 |
| 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 | 2,438,045.00 | 0.51 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 441,466,505.34 | 91.81 |

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 | 002142 | 宁波银行 | 1,604,319 | 28,492,705.44 | 5.93 |
| 2 | 600036 | 招商银行 | 884,024 | 27,130,696.56 | 5.64 |
| 3 | 601318 | 中国平安 | 302,700 | 20,734,950.00 | 4.31 |
| 4 | 600048 | 保利地产 | 1,451,900 | 17,669,623.00 | 3.67 |
| 5 | 600027 | 华电国际 | 4,045,806 | 16,992,385.20 | 3.53 |
| 6 | 600011 | 华能国际 | 2,114,810 | 16,305,185.10 | 3.39 |
| 7 | 600585 | 海螺水泥 | 411,100 | 15,124,369.00 | 3.15 |
| 8 | 601601 | 中国太保 | 416,800 | 14,800,568.00 | 3.08 |
| 9 | 300003 | 乐普医疗 | 423,467 | 12,852,223.45 | 2.67 |
| 10 | 002024 | 苏宁易购 | 945,700 | 12,748,036.00 | 2.65 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货投资，也无期间损益。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本报告期内，本基金未运用股指期货进行投资。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期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、处罚的投资决策程序说明：

招商银行

本报告期，本基金持有招商银行，其发行主体因内控管理严重违反审慎经营规则等违规行为，被中国银保监会处以罚款并没收违法所得。

上述情形对上市公司的财务和经营状况无重大影响，投资决策流程符合基金管理人的制度要求。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 136,254.41 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 9,001.66 |
| 5 | 应收申购款 | 7,159.65 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 152,415.72 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

5.11.6 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

| | |
|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 614,420,039.72 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 2,408,748.11 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 7,260,348.45 |
| 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 | 609,568,439.38 |

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

自2018年8月28日起，宋炳珅先生不再担任工银瑞信红利混合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红利混合型证券投资基金设立的文件；

2.《工银瑞信红利混合型证券投资基金基金合同》；

3.《工银瑞信红利混合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。

# 工银瑞信纯债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：交通银行股份有限公司
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。

基金托管人交通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 | 工银纯债定期开放债券 |
| 场内简称 | 工银纯债 |
| 交易代码 | 164810 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式（本基金自基金合同生效日起每封闭三年集中开放申购与赎回一次） |
| 基金合同生效日 | 2012年6月21日 |
| 报告期末基金份额总额 | 214,745,195.14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。 |
| 投资策略 | 本产品的主要投资策略包括：期限配置策略、类属配置策略、期限结构策略及证券选择策略，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，实现组合资产的增值。 |
| 业绩比较基准 | 三年期银行定期存款税后收益率。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 | 交通银行股份有限公司 |

§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1日 － 2018年9月30日） |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | 105,665.82 |
| 2.本期利润 | 365,931.46 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0016 |
| 4.期末基金资产净值 | 218,097,449.82 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.016 |

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。

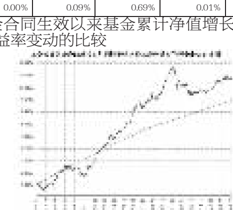
3、所列数据截止到报告期最后一日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

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 | 0.00% | 0.09% | 0.69% | 0.01% | -0.69% | 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2012年6月21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、投资禁止行为与限制的规定：债券等固定收益类资产占基金资产的比例不低于80%，但在每次开放期前三个月、开放期及开放期结束后三个月的期间内，基金投资不受上述比例限制；开放期内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、存出保证金和应收申购款等；封闭期内，本基金不受该比例的限制。

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 | | |
| 李娜 | 本基金的基金经理 | 2017年5月27日 | - | 10 | 曾在中国工商银行总行担任交易员。2016年加入工银瑞信，现任固定收益部基金经理。2017年1月24日至2018年3月20日，担任工银瑞信恒丰纯债债券型证券投资基金基金经理；2017年1月24日至2018年5月3日，担任工银瑞信恒泰纯债债券型证券投资基金基金经理；2017年4月14日至今，担任工银瑞信瑞丰纯债半年定期开放债券型证券投资基金（自2018年6月1日起，变更为工银瑞信瑞丰定期开放纯债债券型发起式证券投资基金）基金经理；2017年5月27日至今，担任工银瑞信纯债定期开放债券型证券投资基金基金经理；2017年5月27日至今，担任工银瑞信目标收益一年定期开放债券型证券投资基金基金经理；2017年6月8日至今，担任工银瑞信瑞利两年封闭式债券型证券投资基金基金经理；2017年6月27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；2018年6月7日至今，担任工银瑞信瑞景定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理；2018年6月11日至今，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。 |

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

国内方面，三季度经济开始步入缓慢下行通道，生产及需求均表现出一定的疲弱，固定资产投资出现一定幅度的下滑，企业投资意愿不足，内需表现乏力，在贸易战不断升级以及欧元区PMI出现下行的影响下，出口下行幅度较大，且这一趋势还将延续；房地产方面依然表现出一定的韧性，但十一房地产销售表现较弱，在房地产调控政策依然较强的背景下，未来房地产面临一定的下行压力。但三季度经济面临的下行压力对货币政策及财政政策形成一定的制约，十一假期最后一天超预期降准100个BP，央行继续维持资金面的宽松格局，同时通过各种政策引导企业信贷投放，尤其是小微企业的再融资难题，对解决信用融资收缩这一困境有一定的缓解作用，未来社融增速有望企稳回升；财政政策上，作为上半年拖累固定资产投资的基建投资有一定企稳的趋势，四季度有可能成为支撑投资增速的主要来源，同时财政部对于减税降费的政策也将逐步出台，对四季度的经济将形成一定的支撑。总体来看，政策的逐步发力会在一定程度上缓解经济下行的压力，四季度经济虽然下行压力依然较大但难以出现超预期的下行。物价方面，菜价及猪肉价格在三季度均有一定程度的超季节上行，同时国际油价也连创新高，对通胀形成一定的压力，但从大的周期来看，年内通胀相对可控，明年通胀有一定的上行压力。国际方面，美国经济继续表现强劲，失业率创48年新低，经济自身的增长动能依然较强，而欧元区PMI继续下行，日本经济出现一定程度的回升。

整体来看，三季度收益率以震荡为主，短端下行幅度较大，高等级信用利差收缩，市场对低等级债券还是出现一定程度的规避，中低等级信用利差继续维持在较高位置。总的来看，三季度收益率曲线陡峭化变动，期限利差处于历史较高位置，其中10年国债利率从3.48%上行至3.62%，1年国债利率从3.16%下行至2.97%，分别变动14BP和-19BP；10年国开债利率从4.25%下行至4.18%，1年国开债利率从3.68%下行至3.01%，分别下行7BP和67BP；3年、5年AAA评级中票整体分别下行37bp和19bp。

工银纯债定开债券基金7月份开放申赎后进入下一个封闭期，本季度以杠杆策略为主，持仓主要为信用债券，维持组合中等久期。

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0.00%，业绩比较基准收益率为0.69%。

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 | 340,705,833.33 | 96.78 |
| | 其中：债券 | 310,675,833.33 | 88.25 |
| | 资产支持证券 | 30,030,000.00 | 8.53 |
| 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 | 5,834,610.77 | 1.66 |
| 8 | 其他资产 | 5,498,500.93 | 1.56 |
| 9 | 合计 | 352,038,945.03 | 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 | 10,172,015.30 | 4.66 |
| | 其中：政策性金融债 | 10,172,015.30 | 4.66 |
| 4 | 企业债券 | 270,345,818.03 | 123.96 |
| 5 | 企业短期融资券 | 10,017,000.00 | 4.59 |
| 6 | 中期票据 | 20,141,000.00 | 9.23 |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 310,675,833.33 | 142.45 |

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 | 112139 | 12北新债 | 209,900 | 21,048,772.00 | 9.65 |
| 2 | 143807 | 18电投07 | 200,000 | 19,998,097.53 | 9.17 |
| 3 | 143408 | 18招金02 | 200,000 | 19,870,000.00 | 9.11 |
| 4 | 112742 | 18万科01 | 200,000 | 19,858,000.00 | 9.11 |
| 5 | 124380 | PR曹妃甸 | 290,000 | 17,492,800.00 | 8.02 |

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 | 139059 | 万科22A1 | 100,000 | 10,015,000.00 | 4.59 |
| 1 | 139056 | 链融2A1 | 100,000 | 10,015,000.00 | 4.59 |
| 3 | 149852 | 中铝租02 | 100,000 | 10,000,000.00 | 4.59 |

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 | 30,460.55 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 5,468,040.38 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 5,498,500.93 |

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

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

| | |
|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 399,224,242.34 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 49,308,836.69 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 233,787,883.89 |
| 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 | 214,745,195.14 |

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 | 0.00 |
| 报告期期间买入/申购总份额 | 29,497,541.79 |
| 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 | 29,497,541.79 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | 13.74 |

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 | 申购 | 2018年7月16日 | 29,497,541.79 | 30,000,000.00 | 0.00% |
| 合计 | | | 29,497,541.79 | 30,000,000.00 | |

注：申购手续费按照500万元以上，每笔固定1000元收取。

§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纯债定期开放债券型证券投资基金设立的文件；

2、《工银瑞信纯债定期开放债券型证券投资基金基金合同》；

3、《工银瑞信纯债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。

# 工银瑞信纯债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：兴业银行股份有限公司
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。

基金托管人兴业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 | 工银纯债债券 | |
| 交易代码 | 000402 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2014年5月16日 | |
| 报告期末基金份额总额 | 4,457,825,551.95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。 | |
| 投资策略 | 本产品的主要投资策略包括：久期策略、类属配置策略、期限结构策略及证券选择策略，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，实现组合资产的增值。 | |
| 业绩比较基准 | 80%×中债信用债（财富）总指数收益率+20%×中债国开行债券（1-3年）总财富指数收益率。 | |
| 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 | 兴业银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 工银纯债债券A | 工银纯债债券B |
| 下属分级基金的交易代码 | 000402 | 000403 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 4,204,981,624.99份 | 252,843,926.96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） | |
|---|---|---|
| | 工银纯债债券A | 工银纯债债券B |
| 1. 本期已实现收益 | 45,442,245.62 | 2,413,064.60 |
| 2. 本期利润 | 98,727,015.30 | 4,750,393.50 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0221 | 0.0188 |
| 4. 期末基金资产净值 | 4,818,404,389.35 | 287,495,379.21 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.1459 | 1.1370 |

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

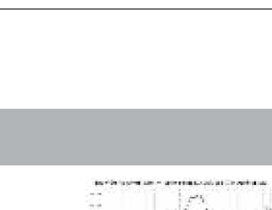
工银纯债债券A

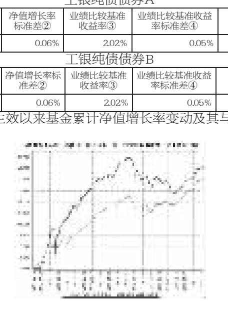
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①－③ | ②－④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 1.88% | 0.06% | 2.02% | 0.05% | -0.14% | 0.01% |

工银纯债债券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 | 1.77% | 0.06% | 2.02% | 0.05% | -0.25% | 0.01% |

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2014年5月16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：本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括国债、地方政府债、金融债、央行票据、中期票据、次级债、企业债、公司债、可分离交易可转债的纯债部分、资产支持证券、短期融资券、银行存款、债券回购等固定收益类金融工具，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具；本基金不直接在二级市场买入股票、权证等权益类资产，也不参与一级市场新股申购和增发新股，可转债仅投资二级市场可分离交易可转债的纯债部分；本基金债券资产占基金资产的比例不低于80%，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、存出保证金和应收申购款等。

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 | | |
| 张略钊 | 本基金的基金经理 | 2017年10月17日 | - | 4 | 2014年加入工银瑞信基金管理有限公司，现任固定收益部利率及衍生品策略高级研究员、基金经理，2017年10月17日至今，担任工银瑞信纯债债券型证券投资基金基金经理；2017年10月17日至今，担任工银瑞信国债纯债债券型证券投资基金基金经理；2017年12月22日至2018年6月28日，担任工银瑞信政府债纯债债券型证券投资基金（LOF）基金经理；2018年8月28日至今，担任工银瑞信增强收益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 | 2017年12月26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。 |

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，中国经济基本面维持下行态势不改，不过幅度仍然温和，显示过去几年供给侧改革取得了明显效果，宏观经济抵御负面冲击的能力有所增强。全球层面来看，中美经济基本面的分化与背离仍然在持续，美国就业市场恢复良好，失业率降至4%以下，创1970年以来新低，但是我国国内经济在前期紧缩政策的影响下，下行压力犹存。中美经济基本面的分化，也体现为人民币兑美元汇率贬值压力的加大，并导致中美货币政策的分化，中国人民银行在三季度通过MLF超额续作等方式继续向金融体系注入流动性，而美联储维持加息进程，货币政策继续紧缩。当前宏观经济总供给并不明显过剩而总需求层面有货币政策的刺激，再叠加人民币汇率贬值压力的加大，未来一段时间的通胀压力值得我们重视。

债券市场表现方面，各类属表现有所分化，短端债券表现好于中长端债券，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%，收益率曲线大幅陡峭化，反映出市场对于未来通胀压力的担心；信用债券的表现好于利率债券，信用利差整体压缩，例如3年期AA+信用债券与同期限国债的利差从二季度末的160BP缩窄至三季度末的119BP，反映出流动性宽松背景下风险偏好的回升。

报告期内本基金根据宏观经济和通胀形势的变化，小幅降低了杠杆水平和久期水平，降低长期限债券资产的配置，增持中短期限债券资产，整体上继续维持对于债券资产的超配。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内，工银纯债债券A份额净值增长率为1.88%，工银纯债债券B份额净值增长率为1.77%，业绩比较基准收益率为2.02%。

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 | 5,273,486,976.33 | 98.08 |
| | 其中：债券 | 5,173,492,976.33 | 96.22 |
| | 资产支持证券 | 99,994,000.00 | 1.86 |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | 200,000.00 | 0.00 |
| | 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 | 11,430,797.29 | 0.21 |
| 8 | 其他资产 | 91,615,295.87 | 1.70 |
| 9 | 合计 | 5,376,733,069.49 | 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 | 545,292,107.30 | 10.68 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 324,513,280.00 | 6.36 |
| | 其中：政策性金融债 | 274,648,280.00 | 5.38 |
| 4 | 企业债券 | 3,262,113,589.03 | 63.89 |
| 5 | 企业短期融资券 | 251,944,000.00 | 4.93 |
| 6 | 中期票据 | 548,426,000.00 | 10.74 |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 地方政府债 | 241,204,000.00 | 4.72 |
| 10 | 其他 | - | - |
| 11 | 合计 | 5,173,492,976.33 | 101.32 |

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 | 160008 | 16附息国债08 | 3,300,000 | 292,611,000.00 | 5.73 |
| 2 | 136014 | 15福投债 | 1,500,000 | 148,935,000.00 | 2.92 |
| 3 | 136283 | 16浙交01 | 1,430,000 | 139,139,000.00 | 2.73 |
| 4 | 160415 | 16农发15 | 1,200,000 | 120,012,000.00 | 2.35 |
| 5 | 112358 | 16BOE01 | 1,110,000 | 110,644,800.00 | 2.17 |

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 | 149296 | 宁远02A3 | 500,000 | 49,955,000.00 | 0.98 |
| 2 | 149448 | 18花呗2A | 200,000 | 20,082,000.00 | 0.39 |
| 3 | 149380 | 18花06A1 | 200,000 | 19,954,000.00 | 0.39 |
| 4 | 149295 | 宁远02A2 | 100,000 | 10,003,000.00 | 0.20 |

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 | 129,936.49 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 91,363,720.94 |
| 5 | 应收申购款 | 121,613.44 |
| 6 | 其他应收款 | 25.00 |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 91,615,295.87 |

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

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 | 工银纯债债券A | 工银纯债债券B |
|---|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 5,327,311,541.76 | 235,646,017.37 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 173,145,406.86 | 73,462,000.52 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 1,295,475,323.63 | 56,264,090.93 |
| 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 | 4,204,981,624.99 | 252,843,926.96 |

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

| 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 | 20180701-20180930 | 2,626,255,135.38 | 0.00 | 1,228,900,000.00 | 1,397,355,135.38 | 31.35% |
| | 2 | 20180701-20180930 | 1,489,027,429.47 | 0.00 | 0.00 | 1,489,027,429.47 | 33.40% |
| 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

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会注册工银瑞信纯债债券型证券投资基金募集的文件；

2、《工银瑞信纯债债券型证券投资基金基金合同》；

3、《工银瑞信纯债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。