

工银瑞信14天理财债券型发起式证券投资基金

2018年第四季度报告

政策以进一步疏通货币传导机制。年底货币市场方面资金面出现一些波动,分层现象仍比较明显,但在总量流动性合理充裕的背景下,四季度大部分时间里资金面整体相对平稳。货币市场收益率较三季度末进一步下行,年末末,7天回购利率从3.01%小幅上行13bp至3.14%,一年期定期存款利率从3.0%继续下行3bp至2.75%。在利率下行周期中,本基金收益从3.69%继续下行10bp至3.59%。

四季度,本基金通过对客户需求和宏观经济与货币市场的判断,积极应对客户年末资产配置调整的需求,合理匹配组合的现金类资产,并在确保流动性的前提下,通过对存款和债券配置的时间安排,增厚组合收益,同时本基金一直严控债券配置的信用资质。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内,工银瑞信14天理财A份额净值增长率为0.8106%,工银瑞信14天理财B份额净值增长率为0.8846%,业绩比较基准收益率为0.3403%。

本基金在报告期内没有申购及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。

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	银行存款	87,348,341.81	88.19
2	买入返售	8,313,512.46	8.31
3	买入返售金融资产	212,500,000.00	212.65
4	买入返售金融资产	1,297,746,481.62	130.8
5	买入返售金融资产	1,297,746,481.62	130.8
6	买入返售金融资产	1,297,746,481.62	130.8
7	买入返售金融资产	1,297,746,481.62	130.8
8	买入返售金融资产	1,297,746,481.62	130.8
9	买入返售金融资产	1,297,746,481.62	130.8
10	买入返售金融资产	1,297,746,481.62	130.8

注:由于四舍五入的原因金额占基金总资产的比例分之和与合计数可能有尾差。

5.2 报告期末债券回购融资情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	443,075,236.27	4.43
2	报告期内债券回购融资余额	443,075,236.27	4.43
3	报告期内债券回购融资余额	443,075,236.27	4.43
4	报告期内债券回购融资余额	443,075,236.27	4.43
5	报告期内债券回购融资余额	443,075,236.27	4.43

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例与报告期内每个交易日融资余额占基金资产净值比例的平均值相近。

5.3 基金投资组合公允价值

本基金在报告期内没有申购及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。

5.4 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	资产名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	资产名称	30,072,000.00	0.3
2	资产名称	28,080,000.00	0.28
3	资产名称	10,000,000.00	0.1
4	资产名称	10,000,000.00	0.1
5	资产名称	10,000,000.00	0.1
6	资产名称	10,000,000.00	0.1
7	资产名称	10,000,000.00	0.1
8	资产名称	10,000,000.00	0.1
9	资产名称	10,000,000.00	0.1
10	资产名称	10,000,000.00	0.1

注:上表中“公允价值”指根据报告期内各交易日期数据计算。

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十名资产支持证券投资明细

序号	资产名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	资产名称	30,072,000.00	0.3
2	资产名称	28,080,000.00	0.28
3	资产名称	10,000,000.00	0.1
4	资产名称	10,000,000.00	0.1
5	资产名称	10,000,000.00	0.1
6	资产名称	10,000,000.00	0.1
7	资产名称	10,000,000.00	0.1
8	资产名称	10,000,000.00	0.1
9	资产名称	10,000,000.00	0.1
10	资产名称	10,000,000.00	0.1

注:上表中“公允价值”指根据报告期内各交易日期数据计算。

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	资产名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	资产名称	30,072,000.00	0.3
2	资产名称	28,080,000.00	0.28
3	资产名称	10,000,000.00	0.1
4	资产名称	10,000,000.00	0.1
5	资产名称	10,000,000.00	0.1
6	资产名称	10,000,000.00	0.1
7	资产名称	10,000,000.00	0.1
8	资产名称	10,000,000.00	0.1
9	资产名称	10,000,000.00	0.1
10	资产名称	10,000,000.00	0.1

注:上表中“公允价值”指根据报告期内各交易日期数据计算。

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十名资产支持证券投资明细

序号	资产名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	资产名称	30,072,000.00	0.3
2	资产名称	28,080,000.00	0.28
3	资产名称	10,000,000.00	0.1
4	资产名称	10,000,000.00	0.1
5	资产名称	10,000,000.00	0.1
6	资产名称	10,000,000.00	0.1
7	资产名称	10,000,000.00	0.1
8	资产名称	10,000,000.00	0.1
9	资产名称	10,000,000.00	0.1
10	资产名称	10,000,000.00	0.1

注:上表中“公允价值”指根据报告期内各交易日期数据计算。

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十名资产支持证券投资明细

序号	资产名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	资产名称	30,072,000.00	0.3
2	资产名称	28,080,000.00	0.28
3	资产名称	10,000,000.00	0.1
4	资产名称	10,000,000.00	0.1
5	资产名称	10,000,000.00	0.1
6	资产名称	10,000,000.00	0.1
7	资产名称	10,000,000.00	0.1
8	资产名称	10,000,000.00	0.1
9	资产名称	10,000,000.00	0.1
10	资产名称	10,000,000.00	0.1

注:上表中“公允价值”指根据报告期内各交易日期数据计算。

5.9 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	资产名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	资产名称	30,072,000.00	0.3
2	资产名称	28,080,000.00	0.28
3	资产名称	10,000,000.00	0.1
4	资产名称	10,000,000.00	0.1
5	资产名称	10,000,000.00	0.1
6	资产名称	10,000,000.00	0.1
7	资产名称	10,000,000.00	0.1
8	资产名称	10,000,000.00	0.1
9	资产名称	10,000,000.00	0.1
10	资产名称	10,000,000.00	0.1

注:上表中“公允价值”指根据报告期内各交易日期数据计算。

5.10 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	资产名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	资产名称	30,072,000.00	0.3
2	资产名称	28,080,000.00	0.28
3	资产名称	10,000,000.00	0.1
4	资产名称	10,000,000.00	0.1
5	资产名称	10,000,000.00	0.1
6	资产名称	10,000,000.00	0.1
7	资产名称	10,000,000.00	0.1
8	资产名称	10,000,000.00	0.1
9	资产名称	10,000,000.00	0.1
10	资产名称	10,000,000.00	0.1

注:上表中“公允价值”指根据报告期内各交易日期数据计算。

5.11 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	资产名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	资产名称	30,072,000.00	0.3
2	资产名称	28,080,000.00	0.28
3	资产名称	10,000,000.00	0.1
4	资产名称	10,000,000.00	0.1
5	资产名称	10,000,000.00	0.1
6	资产名称	10,000,000.00	0.1
7	资产名称	10,000,000.00	0.1
8	资产名称	10,000,000.00	0.1
9	资产名称	10,000,000.00	0.1
10	资产名称	10,000,000.00	0.1

注:上表中“公允价值”指根据报告期内各交易日期数据计算。

5.12 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	资产名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	资产名称	30,072,000.00	0.3
2	资产名称	28,080,000.00	0.28
3	资产名称	10,000,000.00	0.1
4	资产名称	10,000,000.00	0.1
5	资产名称	10,000,000.00	0.1
6	资产名称	10,000,000.00	0.1
7	资产名称	10,000,000.00	0.1
8	资产名称	10,000,000.00	0.1
9	资产名称	10,000,000.00	0.1
10	资产名称	10,000,000.00	0.1

注:上表中“公允价值”指根据报告期内各交易日期数据计算。

5.13 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	资产名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	资产名称	30,072,000.00	0.3
2	资产名称	28,080,000.00	0.28
3	资产名称	10,000,000.00	0.1
4	资产名称	10,000,000.00	0.1
5	资产名称	10,000,000.00	0.1
6	资产名称	10,000,000.00	0.1
7	资产名称	10,000,000.00	0.1
8	资产名称	10,000,000.00	0.1
9	资产名称	10,000,000.00	0.1
10	资产名称	10,000,000.00	0.1

注:上表中“公允价值”指根据报告期内各交易日期数据计算。

5.14 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	资产名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	资产名称	30,072,000.00	0.3
2	资产名称	28,080,000.00	0.28
3	资产名称	10,000,000.00	0.1
4	资产名称	10,000,000.00	0.1
5	资产名称	10,000,000.00	0.1
6	资产名称	10,000,000.00	0.1
7	资产名称	10,000,000.00	0.1
8	资产名称	10,000,000.00	0.1
9	资产名称	10,000,000.00	0.1
10	资产名称	10,000,000.00	0.1

注:上表中“公允价值”指根据报告期内各交易日期数据计算。

5.15 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	资产名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	资产名称	30,072,000.00	0.3
2	资产名称	28,080,000.00	0.28
3	资产名称	10,000,000.00	0.1
4	资产名称	10,000,000.00	0.1
5	资产名称	10,000,000.00	0.1
6	资产名称	10,000,000.00	0.1
7	资产名称	10,000,000.00	0.1
8	资产名称	10,000,000.00	0.1
9	资产名称	10,000,000.00	0.1
10	资产名称	10,000,000.00	0.1

注:上表中“公允价值”指根据报告期内各交易日期数据计算。

5.16 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	资产名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	资产名称	30,072,000.00	0.3
2	资产名称	28,080,000.00	0.28
3	资产名称	10,000,000.00	0.1
4	资产名称	10,000,000.00	0.1
5	资产名称	10,000,000.00	0.1
6	资产名称	10,000,000.00	0.1
7	资产名称	10,000,000.00	0.1
8	资产名称	10,000,000.00	0.1
9	资产名称	10,000,000.00	0.1
10	资产名称	10,000,000.00	0.1

注:上表中“公允价值”指根据报告期内各交易日期数据计算。

5.17 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	资产名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	资产名称	30,072,000.00	0.3
2	资产名称	28,080,000.00	0.28
3	资产名称	10,000,000.00	0.1
4	资产名称	10,000,000.00	0.1
5	资产名称	10,000,000.00	0.1
6	资产名称	10,000,000.00	0.1
7	资产名称	10,000,000.00	0.1
8	资产名称	10,000,000.00	0.1
9	资产名称	10,000,000.00	0.1
10	资产名称	10,000,000.00	0.1

注:上表中“公允价值”指根据报告期内各交易日期数据计算。

5.18 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	资产名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	资产名称	30,072,000.00	0.3
2	资产名称	28,080,000.00	0.28
3	资产名称	10,000,000.00	0.1
4	资产名称	10,000,000.00	0.1
5	资产名称	10,000,000.00	0.1
6	资产名称	10,000,000.00	0.1
7	资产名称	10,000,000.00	0.1
8	资产名称	10,000,000.00	0.1
9	资产名称	10,000,000.00	0.1
10	资产名称	10,000,000.00	0.1

注:上表中“公允价值”指根据报告期内各交易日期数据计算。

5.19 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	资产名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	资产名称	30,072,000.00	0.3
2	资产名称	28,080,000.00	0.28
3	资产名称	10,000,000.00	0.1
4	资产名称	10,000,000.00	0.1
5	资产名称	10,000,000.00	0.1
6	资产名称	10,000,000.00	0.1
7	资产名称	10,000,000.00	0.1
8	资产名称	10,000,000.00	0.1
9	资产名称	10,000,000.00	0.1
10	资产名称	10,000,000.00	0.1

注:上表中“公允价值”指根据报告期内各交易日期数据计算。

5.20 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	资产名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	资产名称	30,072,000.00	0.