

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:二〇一四年一月二十二日
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2014年1月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现、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。

报告期为2013年10月1日起至12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	工银月薪定期支付债券
交易代码	000236
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年8月14日
报告期末基金份额总额	3,024,200,543.54份

在控制风险并保持资产流动性的基础上，通过配置债券型基金资产，追求基金资产的长期稳健增值，以获得相对基准的稳定收益。

本基金在资产配置策略的基础上，通过固定收益类投资和结构化投资组合的平稳收益，通过积极的权益类资产投资追求基金资产的强势型回报。

本基金的业绩比较基准为：三年期银行定期存款收益率(税后)+1%。

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未计费用水平。

(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) 所列数据截至2013年12月31日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本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 -0.40% 0.07% 1.45% 0.02% -1.85% 0.05%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变化率及其与同期业绩比较基准收益率变化率的比较

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未计费用水平。

(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) 所列数据截至2013年12月31日。

3.2.3 本基金份额净值表现

3.2.4 本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 -0.40% 0.07% 1.45% 0.02% -1.85% 0.05%

3.2.5 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变化率及其与同期业绩比较基准收益率变化率的比较

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未计费用水平。

(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) 所列数据截至2013年12月31日。

3.2.6 本基金份额净值表现

3.2.7 本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 -0.40% 0.07% 1.45% 0.02% -1.85% 0.05%

3.2.8 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变化率及其与同期业绩比较基准收益率变化率的比较

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未计费用水平。

(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) 所列数据截至2013年12月31日。

3.2.9 本基金份额净值表现

3.2.10 本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 -0.40% 0.07% 1.45% 0.02% -1.85% 0.05%

3.2.11 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变化率及其与同期业绩比较基准收益率变化率的比较

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未计费用水平。

(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) 所列数据截至2013年12月31日。

3.2.12 本基金份额净值表现

3.2.13 本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 -0.40% 0.07% 1.45% 0.02% -1.85% 0.05%

3.2.14 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变化率及其与同期业绩比较基准收益率变化率的比较

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未计费用水平。

(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) 所列数据截至2013年12月31日。

3.2.15 本基金份额净值表现

3.2.16 本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 -0.40% 0.07% 1.45% 0.02% -1.85% 0.05%

3.2.17 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变化率及其与同期业绩比较基准收益率变化率的比较

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未计费用水平。

(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) 所列数据截至2013年12月31日。

3.2.18 本基金份额净值表现

3.2.19 本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 -0.40% 0.07% 1.45% 0.02% -1.85% 0.05%

3.2.20 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变化率及其与同期业绩比较基准收益率变化率的比较

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未计费用水平。

(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) 所列数据截至2013年12月31日。

3.2.21 本基金份额净值表现

3.2.22 本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 -0.40% 0.07% 1.45% 0.02% -1.85% 0.05%

3.2.23 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变化率及其与同期业绩比较基准收益率变化率的比较

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未计费用水平。

(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) 所列数据截至2013年12月31日。

3.2.24 本基金份额净值表现

3.2.25 本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 -0.40% 0.07% 1.45% 0.02% -1.85% 0.05%

3.2.26 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变化率及其与同期业绩比较基准收益率变化率的比较

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未计费用水平。

(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) 所列数据截至2013年12月31日。

3.2.27 本基金份额净值表现

3.2.28 本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 -0.40% 0.07% 1.45% 0.02% -1.85% 0.05%

3.2.29 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变化率及其与同期业绩比较基准收益率变化率的比较

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未计费用水平。

(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) 所列数据截至2013年12月31日。

3.2.30 本基金份额净值表现

3.2.31 本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 -0.40% 0.07% 1.45% 0.02% -1.85% 0.05%

3.2.32 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变化率及其与同期业绩比较基准收益率变化率的比较

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未计费用水平。

(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) 所列数据截至2013年12月31日。

3.2.33 本基金份额净值表现

3.2.34 本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 -0.40% 0.07% 1.45% 0.02% -1.85% 0.05%

3.2.35 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变化率及其与同期业绩比较基准收益率变化率的比较

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未计费用水平。

(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) 所列数据截至2013年12月31日。

3.2.36 本基金份额净值表现

3.2.37 本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 -0.40% 0.07% 1.45% 0.02% -1.85% 0.05%

3.2.38 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变化率及其与同期业绩比较基准收益率变化率的比较

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未计费用水平。

(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) 所列数据截至2013年12月31日。

3.2.39 本基金份额净值表现

3.2.40 本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 -0.40% 0.07% 1.45% 0.02% -1.85% 0.05%

3.2.41 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变化率及其与同期业绩比较基准收益率变化率的比较

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未计费用水平。

(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) 所列数据截至2013年12月31日。

3.2.42 本基金份额净值表现

3.2.43 本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</