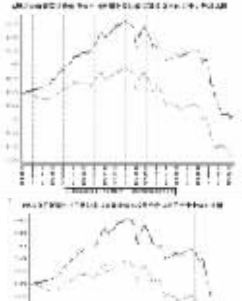


工银瑞信信用纯债债券型证券投资基金

【2013】 第四季度报告

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11月14日生效。
2、按基金合同规定，本基金建仓期为96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；债券等固定收益类资产占基金资产净值的比例不低于80%，其中中债企业债、中期票据等、商业银行金融债与次级债、资产支持证券、中期票据等企业机构发行的债券占固定收益类资产的比例不低于80%；基金持有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%。
3.3 其他指标
无。

§ 4 管理人报告

姓名	职务	任本基金的基金经理期限 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
何秀红	本基金的基金经理	2012年11月14日	-	6	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，曾任固定收益研究员，2011年2月10日至今，担任工银瑞信信用纯债债券型证券投资基金基金经理，2011年12月27日至今担任工银瑞信信用纯债债券型证券投资基金基金经理，2012年11月14日至今担任工银瑞信信用纯债债券型证券投资基金基金经理，2013年3月29日至今，担任工银瑞信信用纯债债券型证券投资基金基金经理，2013年5月22日至今，担任工银瑞信信用纯债债券型证券投资基金基金经理，2013年6月24日起至今，担任工银瑞信信用纯债债券型证券投资基金基金经理。

4.2 管理人对于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者，保护各类投资者利益，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》、《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》等法律法规和公司内部规章，制定了《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的价差较大，可能存在操纵股价、利益输送等违法违规行为进行监控。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执行操作，实现了公平交易，未出现清算不到位的的情况，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
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超过该证券当日成交量的5%的情况有5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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.1 报告期内基金的投资策略和运作分析
四季度，宏观经济企稳，通胀相对四季度也略有下降，但是增长和通胀这种较小波动不至于使得央行货币政策放松。债券市场的结构性机会也需要等待，春节后的季节性资金宽松可能使得市场得到缓解，但短期度有限，信用风险一般成为市场共同担心的点，而政策对城投债兑付的隐性担保城投债违约风险较小。但是，流动性持续紧张和经济放缓叠加企业高负债运作，产业债成为市场关注重点。这个阶段偏长期和短期信用债等是首要选项，等待利率机会到来，可转债仅仅存在条款博弈机会，没有趋势性。
信用债估值逐渐走低信用评级信用债，适当降低组合杠杆。
4.4.2 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
报告期内，工银信用纯债A净值收益率-4.20%，工银信用纯债B净值收益率-4.31%，业绩比较基准收益率-4.4%。
4.5 管理人对于宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
一季度，经济增长将放缓，通胀相对四季度也略有下降，但是增长和通胀这种较小波动不至于使得央行货币政策放松。债券市场的结构性机会也需要等待，春节后的季节性资金宽松可能使得市场得到缓解，但短期度有限，信用风险一般成为市场共同担心的点，而政策对城投债兑付的隐性担保城投债违约风险较小。但是，流动性持续紧张和经济放缓叠加企业高负债运作，产业债成为市场关注重点。这个阶段偏长期和短期信用债等是首要选项，等待利率机会到来，可转债仅仅存在条款博弈机会，没有趋势性。
信用债估值逐渐走低信用评级信用债，适当降低组合杠杆。

格和市场价格价差较大，可能存在操纵股价、利益输送等违法违规行为进行监控。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执行操作，实现了公平交易，未出现清算不到位的的情况，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
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超过该证券当日成交量的5%的情况有5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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.1 报告期内基金的投资策略和运作分析
四季度，宏观经济企稳，通胀相对四季度也略有下降，但是增长和通胀这种较小波动不至于使得央行货币政策放松。债券市场的结构性机会也需要等待，春节后的季节性资金宽松可能使得市场得到缓解，但短期度有限，信用风险一般成为市场共同担心的点，而政策对城投债兑付的隐性担保城投债违约风险较小。但是，流动性持续紧张和经济放缓叠加企业高负债运作，产业债成为市场关注重点。这个阶段偏长期和短期信用债等是首要选项，等待利率机会到来，可转债仅仅存在条款博弈机会，没有趋势性。
信用债估值逐渐走低信用评级信用债，适当降低组合杠杆。

4.4.2 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
报告期内，工银信用纯债A净值收益率-4.20%，工银信用纯债B净值收益率-4.31%，业绩比较基准收益率-4.4%。
4.5 管理人对于宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
一季度，经济增长将放缓，通胀相对四季度也略有下降，但是增长和通胀这种较小波动不至于使得央行货币政策放松。债券市场的结构性机会也需要等待，春节后的季节性资金宽松可能使得市场得到缓解，但短期度有限，信用风险一般成为市场共同担心的点，而政策对城投债兑付的隐性担保城投债违约风险较小。但是，流动性持续紧张和经济放缓叠加企业高负债运作，产业债成为市场关注重点。这个阶段偏长期和短期信用债等是首要选项，等待利率机会到来，可转债仅仅存在条款博弈机会，没有趋势性。
信用债估值逐渐走低信用评级信用债，适当降低组合杠杆。

4.4.2 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
报告期内，工银信用纯债A净值收益率-4.20%，工银信用纯债B净值收益率-4.31%，业绩比较基准收益率-4.4%。
4.5 管理人对于宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
一季度，经济增长将放缓，通胀相对四季度也略有下降，但是增长和通胀这种较小波动不至于使得央行货币政策放松。债券市场的结构性机会也需要等待，春节后的季节性资金宽松可能使得市场得到缓解，但短期度有限，信用风险一般成为市场共同担心的点，而政策对城投债兑付的隐性担保城投债违约风险较小。但是，流动性持续紧张和经济放缓叠加企业高负债运作，产业债成为市场关注重点。这个阶段偏长期和短期信用债等是首要选项，等待利率机会到来，可转债仅仅存在条款博弈机会，没有趋势性。
信用债估值逐渐走低信用评级信用债，适当降低组合杠杆。

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	固定收益投资	1,653,571,973.61	94.57
其中：债券	1,653,571,973.61	94.57	
资产支持证券	-	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	32,851,669.01	1.88
6	其他资产	62,053,441.88	3.55
7	合计	1,748,477,084.50	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
本基金本报告期末未持有股票。
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 49,661,000.00 5.47
其中：政策性金融债 49,661,000.00 5.47
4 企业债券 902,426,973.61 99.33
5 企业短期融资券 - -
6 中期票据 701,484,000.00 77.21
7 可转债 - -
8 其他 - -
9 合计 1,653,571,973.61 182.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
本基金本报告期末未持有股票。
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 49,661,000.00 5.47
其中：政策性金融债 49,661,000.00 5.47
4 企业债券 902,426,973.61 99.33
5 企业短期融资券 - -
6 中期票据 701,484,000.00 77.21
7 可转债 - -
8 其他 - -
9 合计 1,653,571,973.61 182.00

格和市场价格价差较大，可能存在操纵股价、利益输送等违法违规行为进行监控。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执行操作，实现了公平交易，未出现清算不到位的的情况，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
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超过该证券当日成交量的5%的情况有4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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.1 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
四季度，宏观经济企稳，通胀相对四季度也略有下降，但是增长和通胀这种较小波动不至于使得央行货币政策放松。债券市场的结构性机会也需要等待，春节后的季节性资金宽松可能使得市场得到缓解，但短期度有限，信用风险一般成为市场共同担心的点，而政策对城投债兑付的隐性担保城投债违约风险较小。但是，流动性持续紧张和经济放缓叠加企业高负债运作，产业债成为市场关注重点。这个阶段偏长期和短期信用债等是首要选项，等待利率机会到来，可转债仅仅存在条款博弈机会，没有趋势性。
信用债估值逐渐走低信用评级信用债，适当降低组合杠杆。
4.4.2 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
报告期内，工银信用纯债A净值增长率0.10%，工银信用纯债B净值增长率0.00%，业绩比较基准收益率1.06%。
4.5 管理人对于宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
一季度，经济增长将放缓，通胀相对四季度也略有下降，但是增长和通胀这种较小波动不至于使得央行货币政策放松。债券市场的结构性机会也需要等待，春节后的季节性资金宽松可能使得市场得到缓解，但短期度有限，信用风险一般成为市场共同担心的点，而政策对城投债兑付的隐性担保城投债违约风险较小。但是，流动性持续紧张和经济放缓叠加企业高负债运作，产业债成为市场关注重点。这个阶段偏长期和短期信用债等是首要选项，等待利率机会到来，可转债仅仅存在条款博弈机会，没有趋势性。
信用债估值逐渐走低信用评级信用债，适当降低组合杠杆。

4.4.2 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
报告期内，工银信用纯债A净值增长率0.10%，工银信用纯债B净值增长率0.00%，业绩比较基准收益率1.06%。
4.5 管理人对于宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
一季度，经济增长将放缓，通胀相对四季度也略有下降，但是增长和通胀这种较小波动不至于使得央行货币政策放松。债券市场的结构性机会也需要等待，春节后的季节性资金宽松可能使得市场得到缓解，但短期度有限，信用风险一般成为市场共同担心的点，而政策对城投债兑付的隐性担保城投债违约风险较小。但是，流动性持续紧张和经济放缓叠加企业高负债运作，产业债成为市场关注重点。这个阶段偏长期和短期信用债等是首要选项，等待利率机会到来，可转债仅仅存在条款博弈机会，没有趋势性。
信用债估值逐渐走低信用评级信用债，适当降低组合杠杆。

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	固定收益投资	6,431,687,839.92	81.73
其中：债券	6,431,687,839.92	81.73	
资产支持证券	-	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	1,334,462,659.94	16.96
6	其他资产	103,285,401.08	1.31
7	合计	7,869,435,900.94	100.00

注：由于四舍五入的原因金额与基金总资产的比例之和合计可能有尾差。
5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
本基金本报告期末未持有股票。
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 472,370,000.00 7.60
其中：政策性金融债 472,370,000.00 7.60
4 企业债券 2,731,375,839.92 43.93
5 企业短期融资券 2,796,204,000.00 44.97
6 中期票据 431,738,000.00 6.94
7 可转债 - -
8 其他 - -
9 合计 6,431,687,839.92 103.44

注：由于四舍五入的原因金额与基金总资产的比例之和合计可能有尾差。
5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
本基金本报告期末未持有股票。
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 472,370,000.00 7.60
其中：政策性金融债 472,370,000.00 7.60
4 企业债券 2,731,375,839.92 43.93
5 企业短期融资券 2,796,204,000.00 44.97
6 中期票据 431,738,000.00 6.94
7 可转债 - -
8 其他 - -
9 合计 6,431,687,839.92 103.44

注：由于四舍五入的原因金额与基金总资产的比例之和合计可能有尾差。
5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
本基金本报告期末未持有股票。
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 472,370,000.00 7.60
其中：政策性金融债 472,370,000.00 7.60
4 企业债券 2,731,375,839.92 43.93
5 企业短期融资券 2,796,204,000.00 44.97
6 中期票据 431,738,000.00 6.94
7 可转债 - -
8 其他 - -
9 合计 6,431,687,839.92 103.44

注：由于四舍五入的原因金额与基金总资产的比例之和合计可能有尾差。
5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
本基金本报告期末未持有股票。
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 472,370,000.00 7.60
其中：政策性金融债 472,370,000.00 7.60
4 企业债券 2,731,375,839.92 43.93
5 企业短期融资券 2,796,204,000.00 44.97
6 中期票据 431,738,000.00 6.94
7 可转债 - -
8 其他 - -
9 合计 6,431,687,839.92 103.44

注：由于四舍五入的原因金额与基金总资产的比例之和合计可能有尾差。
5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
本基金本报告期末未持有股票。
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 472,370,000.00 7.60
其中：政策性金融债 472,370,000.00 7.60
4 企业债券 2,731,375,839.92 43.93
5 企业短期融资券 2,796,204,000.00 44.97
6 中期票据 431,738,000.00 6.94
7 可转债 - -
8 其他 - -
9 合计 6,431,687,839.92 103.44

注：由于四舍五入的原因金额与基金总资产的比例之和合计可能有尾差。
5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
本基金本报告期末未持有股票。
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 472,370,000.00 7.60
其中：政策性金融债 472,370,000.00 7.60
4 企业债券 2,731,375,839.92 43.93
5 企业短期融资券 2,796,204,000.00 44.97
6 中期票据 431,738,000.00 6.94
7 可转债 - -
8 其他 - -
9 合计 6,431,687,839.92 103.44

注：由于四舍五入的原因金额与基金总资产的比例之和合计可能有尾差。
5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
本基金本报告期末未持有股票。
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 472,370,000.00 7.60
其中：政策性金融债 472,370,000.00 7.60
4 企业债券 2,731,375,839.92 43.93
5 企业短期融资券 2,796,204,000.00 44.97
6 中期票据 431,738,000.00 6.94
7 可转债 - -
8 其他 - -
9 合计 6,431,687,839.92 103.44

注：由于四舍五入的原因金额与基金总资产的比例之和合计可能有尾差。
5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
本基金本报告期末未持有股票。
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 472,370,000.00 7.60
其中：政策性金融债 472,370,000.00 7.60
4 企业债券 2,731,375,839.92 43.93
5 企业短期融资券 2,796,204,000.00 44.97
6 中期票据 431,738,000.00 6.94
7 可转债 - -
8 其他 - -
9 合计 6,431,687,839.92 103.44

注：由于四舍五入的原因金额与基金总资产的比例之和合计可能有尾差。
5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
本基金本报告期末未持有股票。
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 472,370,000.00 7.60
其中：政策性金融债 472,370,000.00 7.60
4 企业债券 2,731,375,839.92 43.93
5 企业短期融资券 2,796,204,000.00 44.97
6 中期票据 431,738,000.00 6.94
7 可转债 - -
8 其他 - -
9 合计 6,431,687,839.92 103.44

注：由于四舍五入的原因金额与基金总资产的比例之和合计可能有尾差。
5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
本基金本报告期末未持有股票。
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 472,370,000.00 7.60
其中：政策性金融债 472,370,000.00 7.60
4 企业债券 2,731,375,839.92 43.93
5 企业短期融资券 2,796,204,000.00 44.97
6 中期票据 431,738,000.00 6.94
7 可转债 - -
8 其他 - -
9 合计 6,431,687,839.92 103.44

注：由于四舍五入的原因公允价值占基金资产净值的比例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 124161 13国债16 649,990 62,301,541.50 6.86
2 121144 12国债06 600,000 58,200,000.00 6.41
3 1382217 13兴业MTN1 600,000 57,264,000.00 6.30
4 1382214 13赣桥桥MTN2 600,000 56,448,000.00 6.21
5 1382003 13西王MTN1 500,000 49,165,000.00 5.41

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权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
5.8.1 本报告期内股指期货投资政策
本报告期内，本基金未运用股指期货进行投资。
5.8.2 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。
5.8.3 本报告期内股指期货投资评价
无。
5.9 投资组合报告附注
5.9.1 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、处罚的情况。
5.9.2 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。
5.9.3 其他资产构成
序号 名称 金额(元)
1 存出保证金 -
2 应收证券清算款 -
3 应收股利 -
4 应收利息 43,250,913.28
5 应收申购款 -
6 其他应收款 182,829.90
7 待摊费用 -
8 其他 -
9 合计 62,053,441.88

5.9.4 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可转换债券。
5.9.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。
5.9.6 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 工银信用纯债债券A 工银信用纯债债券B
报告期期初基金份额总额 742,144,082.29 924,222,595.54
报告期期间基金总申购份额 8,249,716.65 24,026,954.95
减：报告期期间基金总赎回份额 276,444,652.37 494,947,064.32
报告期期间基金净变动份额(份额减少以“-”填列) - 182,829.90
报告期末基金份额总额 473,949,146.57 453,302,249.97

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况
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五名债券投资明细
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
5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
5.8.1 本报告期内股指期货投资政策
本报告期内，本基金未运用股指期货进行投资。
5.8.2 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。
5.8.3 本报告期内股指期货投资评价
无。
5.9 投资组合报告附注
5.9.1 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、处罚的情况。
5.9.2 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。
5.9.3 其他资产构成
序号 名称 金额(元)
1 存出保证金 -
2 应收证券清算款 -
3 应收股利 -
4 应收利息 43,250,913.28
5 应收申购款 -
6 其他应收款 182,829.90
7 待摊费用 -
8 其他 -
9 合计 62,053,441.88

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息
1、基金管理人于2013年10月30日在指定媒体及公司网站上披露了《工银瑞信基金管理有限公司董事长变更公告》，李蔚麟先生辞去公司董事长职务，董事长变更为陈焕祥先生。
2、基金管理人于2013年12月28日在指定媒体及公司网站上披露了《工银瑞信基金管理有限公司关于变更法定代表人公告》，法定代表人变更为胡华伟女士。
§ 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信用纯债债券型证券投资基金设立的文件；
2、《工银瑞信信用纯债债券型证券投资基金托管协议》；
3、《工银瑞信信用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和营业场所证明；
5、基金管理人业务资格和营业场所证明；
6、报告期内基金管理人及基金托管人披露的各项公告。
9.2 存放地点
基金管理人或基金托管人住所。
9.3 查阅方式
投资者可在营业时间内免费查阅，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。

§ 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信用纯债债券型证券投资基金设立的文件；
2、《工银瑞信信用纯债债券型证券投资基金托管协议》；
3、《工银瑞信信用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和营业场所证明；
5、基金管理人业务资格和营业场所证明；
6、报告期内基金管理人及基金托管人披露的各项公告。
9.2 存放地点
基金管理人或基金托管人住所。
9.3 查阅方式
投资者可在营业时间内免费查阅，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。

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 130228 13国债28 1,700,000 162,826,000.00 2.62
2 041356031 13中财P002 1,300,000 129,077,000.00 2.08
3 130237 13国债37 1,200,000 116,232,000.00 1.87
4 112190 11亚运02 1,100,000 108,350,000.00 1.74
5 041358064 13中财P002 1,000,000 99,370,000.00 1.60

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十名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
5.8.1 本报告期内股指期货投资政策
本报告期内，本基金未运用股指期货进行投资。
5.8.2 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。
5.8.3 本报告期内股指期货投资评价
无。
5.9 投资组合报告附注
5.9.1 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、处罚的情况。
5.9.2 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。
5.9.3 其他资产构成
序号 名称 金额(元)
1 存出保证金 -
2 应收证券清算款 -
3 应收股利 -
4 应收利息 102,596,266.18
5 应收申购款 -
6 其他应收款 30,000.00
7 待摊费用 -
8 其他 -
9 合计 103,285,401.08

5.9.4 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可转换债券。
5.9.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。
5.9.6 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 工银信用纯债一年定期开放债券A 工银信用纯债一年定期开放债券B
报告期期初基金份额总额 3,446,261,869.56 2,662,002,074.58
报告期期间基金总申购份额 - -
减：报告期期间基金总赎回份额 - -
报告期期间基金净变动份额(份额减少以“-”填列) - -
报告期末基金份额总额 3,446,261,869.56 2,662,002,074.58

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况
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五名债券投资明细
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
5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
5.8.1 本报告期内股指期货投资政策
本报告期内，本基金未运用股指期货进行投资。
5.8.2 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。
5.8.3 本报告期内股指期货投资评价
无。
5.9 投资组合报告附注
5.9.1 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、处罚的情况。
5.9.2 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。
5.9.3 其他资产构成
序号 名称 金额(元)
1 存出保证金 -
2 应收证券清算款 -
3 应收股利 -
4 应收利息 102,596,266.18
5 应收申购款 -
6 其他应收款 30,000.00
7 待摊费用 -
8 其他 -
9 合计 103,285,401.08

5.9.4 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可转换债券。
5.9.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。
5.9.6 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 工银信用纯债一年定期开放债券A 工银信用纯债一年定期开放债券B
报告期期初基金份额总额 3,446,261,869.56 2,662,002,074.58
报告期期间基金总申购份额 - -
减：报告期期间基金总赎回份额 - -
报告期期间基金净变动份额(份额减少以“-”填列) - -
报告期末基金份额总额 3,446,261,869.56 2,662,002,074.58

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息
1、基金管理人于2013年10月30日在指定媒体及公司网站上披露了《工银瑞信基金管理有限公司董事长变更公告》，李蔚麟先生辞去公司董事长职务，董事长变更为陈焕祥先生。
2、基金管理人于2013年12月28日在指定媒体及公司网站上披露了《工银瑞信基金管理有限公司关于变更法定代表人公告》，法定代表人变更为胡华伟女士。
§ 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信用纯债一年定期开放债券型证券投资基金设立的文件；
2、《工银瑞信信用纯债一年定期开放债券型证券投资基金托管协议》；
3、《工银瑞信信用纯债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和营业场所证明；
5、基金管理人业务资格和营业场所证明；
6、报告期内基金管理人及基金托管人披露的各项公告。
9.2 存放地点
基金管理人或基金托管人住所。
9.3 查阅方式
投资者可在营业时间内免费查阅，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。