

基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一四年一月二十二日
§ 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。
基金托管人中国农业银行股份有限公司根据基金合同规定，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。
本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2013年10月1日起至12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 工银信用纯债债券

交易代码 485119

基金运作方式 购买型开放式

基金合同生效日 2012年11月14日

报告期末基金份额总额 927,251,396.54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。

本基金通过主要投资于公司债券、企业债券等企业

机构发行的固定收益类金融工具，在承担适度风险

的前提下，从利率、信用等角度深入研究，充分挖掘

信用债市场的投资机会，优化组合，实现超出市

场平均水平的收益。

中债企业债全价指数收益率×80%+中债国债总

价指数收益率×20%

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 中国农业银行股份有限公司

下属两级基金的基金简称 工银信用纯债债券A

工银信用纯债债券B

下属两级基金的交易代码 485119 485019

473,949,146.57份 453,302,249.97份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2013年10月1日 - 2013年12月31日)

工银信用纯债债券A 工银信用纯债债券B

1.本期已实现收益 -6,304,475.43 -7,733,702.23

2.本期利润 -23,528,676.04 -26,761,045.55

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0405 -0.0410

4.期末基金资产净值 465,572,770.93 442,982,406.47

5.期末基金份额净值 0.982 0.977

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”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2013年12月31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

工银信用纯债债券A

6.1.1 业绩比较基准

业绩比较基准收益率 0.12% 0.12%

业绩比较基准收益率差 3.14% 0.09%

1.06% -0.06%

0.03%

工银信用纯债债券B

6.1.2 业绩比较基准

业绩比较基准收益率 0.12% 0.12%

业绩比较基准收益率差 3.14% 0.09%

-1.06% 0.04%

过去三个月

3.2.2 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

工银信用纯债一年定期定开债券C

6.1.1 业绩比较基准

业绩比较基准收益率 0.12% 0.12%

业绩比较基准收益率差 3.14% 0.09%

1.06% -0.06%

0.04%

过去三个月

3.2.3 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

工银信用纯债一年定期定开债券C

6.1.1 业绩比较基准

业绩比较基准收益率 0.12% 0.12%

业绩比较基准收益率差 3.14% 0.09%

1.06% -0.06%

0.04%

过去三个月

3.3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2013年10月1日 - 2013年12月31日)

工银信用纯债一年定期定开债券A 工银信用纯债一年定期定开债券C

1.本期已实现收益 40,599,202.67 28,570,720.12

2.本期利润 3,141,947.03 -306,206.25

3.加权平均基金份额本期利润 0.0009 -0.0001

4.期末基金资产净值 3,511,866,365.20 2,706,058,659.79

5.期末基金份额净值 1.019 1.017

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”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2013年12月31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

工银信用纯债一年定期定开债券A

6.1.1 业绩比较基准

业绩比较基准收益率 0.12% 0.12%

业绩比较基准收益率差 3.14% 0.09%

1.06% -0.06%

0.04%

过去三个月

3.2.2 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

工银信用纯债一年定期定开债券C

6.1.1 业绩比较基准

业绩比较基准收益率 0.12% 0.12%

业绩比较基准收益率差 3.14% 0.09%

1.06% -0.06%

0.04%

过去三个月

3.2.3 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

工银信用纯债一年定期定开债券C

6.1.1 业绩比较基准

业绩比较基准收益率 0.12% 0.12%

业绩比较基准收益率差 3.14% 0.09%

1.06% -0.06%

0.04%

过去三个月

3.3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2013年10月1日 - 2013年12月31日)

工银信用纯债一年定期定开债券A 工银信用纯债一年定期定开债券C

1.本期已实现收益 10,869,402.64 3,410,954.13

2.本期利润 -2,031,846.13 -1,013,306.26

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0022 -0.0033

4.期末基金资产净值 915,297,680.83 313,297,254.54

5.期末基金份额净值 1.013 1.011

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”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2013年12月31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

工银信用纯债一年定期定开债券A

6.1.1 业绩比较基准

业绩比较基准收益率 0.12% 0.12%

业绩比较基准收益率差 3.14% 0.09%

1.06% -0.06%

0.04%

过去三个月

3.2.2 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

工银信用纯债一年定期定开债券C

6.1.1 业绩比较基准

业绩比较基准收益率 0.12% 0.12%

业绩比较基准收益率差 3.14% 0.09%

1.06% -0.06%

0.04%

过去三个月

3.2.3 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

工银信用纯债一年定期定开债券C

6.1.1 业绩比较基准

业绩比较基准收益率 0.12% 0.12%

业绩比较基准收益率差 3.14% 0.09%

1.06% -0.06%

0.04%

过去三个月

3.3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2013年10月1日 - 2013年12月31日)

工银信用纯债一年定期定开债券A 工银信用纯债一年定期定开债券C

1.本期已实现收益 10,869,402.64 3,410,954.13

2.本期利润 -2,031,846.13 -1,013,306.26

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0022 -0.0033

4.期末基金资产净值 915,297,680.83 313,297,254.54

5.期末基金份额净值 1.013 1.01