

工银瑞信添福债券型证券投资基金

[2013] 第四季度报告

基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司

基金托管人:中国民生银行股份有限公司

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。

基金托管人中国民生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、收益分配政策、基金资产净值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。

基金过往业绩并不代表其未来表现。投资人风险，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。

报告期自2013年10月31日起至12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 工银添福债券

交易代码 000184

基金运作方式 约定型开放式

基金合同生效日 2013年10月31日

报告期末基金份额总额 761,785,555.22份

投资目标 在保持基金资产流动性与控制基金风险的前提下，力争实现超越业绩比较基准的长期投资回报，为投资者提供长线投资的工具。

本基金将采取利率策略、信用策略、债券选择策略等积极投资策略，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，以实现组合增值的目标。

业绩比较基准 三年定期存款利率+1.5%。

风险收益特征 本基金为债券型基金，预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

基金管理人 工银瑞信基金管理有限公司

基金托管人 中国民生银行股份有限公司

下属两级基金的基金简称 工银添福债券A

工银添福债券B

下属两级基金的交易代码 000184 000185

报告期末下属两级基金的份额总额 399,144,081.01份 362,641,474.21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

报告期(2013年10月31日-2013年12月31日)

工银添福债券A 工银添福债券B

1.本期已实现收益 3,007,844.95 4,288,527.70

2.本期利润 1,842,437.41 1,430,146.23

3.加权平均基金份额本期利润 0.0049 0.0042

4.期末基金资产净值 400,988,352.95 364,073,777.72

5.期末基金份额净值 1.0005 1.0004

注:1.上表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. 所列数据截止至2013年12月31日。

4.2 本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

工银添福债券A

阶段 净值增长(%) 净值增长率(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.0600% 0.9800% 0.0100% -0.4800% 0.0500%

工银添福债券B

阶段 净值增长(%) 净值增长率(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.0600% 0.9800% 0.0100% -0.5800% 0.0500%

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

工银添福债券A

阶段 净值增长(%) 净值增长率(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.0600% 0.9800% 0.0100% -0.5800% 0.0500%

3.2.3 本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

工银添福债券B

阶段 净值增长(%) 净值增长率(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.0600% 0.9800% 0.0100% -0.5800% 0.0500%

3.3 其他指标

3.4 管理人报告

4.1 基金经理(基金经理小组)简介

姓名 职务 任期日期 离任日期 说明

杜海涛 固定收益投资总监兼基金经理 2013年10月31日 -

注:1.本基金管理合同于2013年10月31日生效，截至报告期末，本基金合同生效不满一年。

2. 投资组合报告 本基金建仓期为6个月，建仓期间，本基金的各项投资比例符合本基金合同关于投资范围及投资限制的规定：债券占基金资产的比例不低于80%；股票等权益类资产占基金资产的比例不超过20%，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. 其他指标

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规情况的说明

本报告期内，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，依照诚信原则，勤勉尽责的原则管理运用基金资产，在控制风险的基础上，为基金份额持有人谋取最大利益，无损害基金份额持有人的利益的行为。

4.3 公平交易制度的执行情况

为了公平对待所有投资人利益，保护各类投资人利益，避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违纪行为，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》、《证券投资基金评价办法》、《证券投资基金销售适用性指导意见》等法律法规及公司内部规章制度，拟定了《公平交易管理办法》、《异常交易管理规定》，对公司的各类资产的公平对待做了明确规定，制定了公平交易制度，对不同投资组合，按照价格优先、时间优先、价格优先的原则，同时对同一证券或相同交易类型的基金进行投资组合，均采用系统中的公平交易模块进行操作，实现了公平交易，未出现明显不公允的情况。且本基金及本公司基金管理人对其他投资组合之间未发生法律纠纷禁止的反向交易及交叉交易。

4.3.2 禁止内幕交易和操纵市场的规定

本基金在报告期内未出现内幕交易、操纵市场的规定的情况。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数较少的的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况5次。投资组合经理因投资组合的决策策略和业务发表观点。

4.4 报告期内本基金的公平交易策略和结果表明

本基金报告期内未出现不公平交易和利益输送。

3. 所列数据截止至2013年12月31日。

3.2.3 本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

工银添福债券A

阶段 净值增长(%) 净值增长率(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -3.30% 0.18% 1.58% 0.02% -4.88% 0.16%

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

工银添福债券B

阶段 净值增长(%) 净值增长率(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -0.50% 0.18% 1.58% 0.02% -0.52% -0.16%

3.2.3 本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

工银添福债券A

阶段 净值增长(%) 净值增长率(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -3.30% 0.18% 1.58% 0.02% -4.88% 0.16%

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

工银添福债券B

阶段 净值增长(%) 净值增长率(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -0.50% 0.18% 1.58% 0.02% -0.52% -0.16%

3.2.3 本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

工银添福债券A

阶段 净值增长(%) 净值增长率(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -3.30% 0.18% 1.58% 0.02% -4.88% 0.16%

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

工银添福债券B

阶段 净值增长(%) 净值增长率(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -0.50% 0.18% 1.58% 0.02% -0.52% -0.16%

3.2.3 本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

工银添福债券A

阶段 净值增长(%) 净值增长率(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -3.30% 0.18% 1.58% 0.02% -4.88% 0.16%

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

工银添福债券B

阶段 净值增长(%) 净值增长率(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -0.50% 0.18% 1.58% 0.02% -0.52% -0.16%

3.2.3 本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

工银添福债券A

阶段 净值增长(%) 净值增长率(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -3.30% 0.18% 1.58% 0.02% -4.88% 0.16%

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

工银添福债券B

阶段 净值增长(%) 净值增长率(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -0.50% 0.18% 1.58% 0.02% -0.52% -0.16%

3.2.3 本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

工银添福债券A

阶段 净值增长(%) 净值增长率(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -3.30% 0.18% 1.58% 0.02% -4.88% 0.16%

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

工银添福债券B

阶段 净值增长(%) 净值增长率(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -0.50% 0.18% 1.58% 0.02% -0.52% -0.16%

3.2.3 本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

工银添福债券A

阶段 净值增长(%) 净值增长率(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -3.30% 0.18% 1.58% 0.02% -4.88% 0.16%

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

工银添福债券B

阶段 净值增长(%) 净值增长率(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -0.50% 0.18% 1.58% 0.02% -0.52% -0.16%

3.2.3 本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

工银添福债券A

阶段 净值增长(%) 净值增长率(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -3.30% 0.18% 1.58% 0.02% -4.88% 0.16%

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

工银添福债券B

阶段 净值增长(%) 净值增长率(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -0.50% 0.18% 1.58% 0.02% -0.52% -0.16%

3.2.3 本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

工银添福债券A

阶段 净值增长(%) 净值增长率(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -3.30% 0.18% 1.58% 0.02% -4.88% 0.16%

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

工银添福债券B

阶段 净值增长(%) 净值增长率(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④