

工银瑞信60天理财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:兴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

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、完整性、及时性承担个别及连带责任。

基金合同由基金管理人和基金托管人根据法律法规及基金合同规定，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数据，保证复核结果不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人和基金托管人承诺以诚实信用、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。

本基金定期报告文本经审计。

本报告期自2013年10月1日起至2013年12月31日止。

1.2 基金产品概况

基金简称 工银60天理财债券

交易代码 485122

基金运作方式 购买型开放式

基金合同生效日 2013年1月28日

报告期末基金份额总额 561,994,105.10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稳定的投资收益。

投资策略 本基金将采取积极的主动管理策略，运用策略，相对价值策略等积极投资策略，在严格控制风险的前提下，发掘和利用市场中被低估的投资机会，实现资产增值。

业绩比较基准 人民币活期存款利率(税后)+0.4%

风险收益特征 本基金为债券型基金，投资风险和收益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 兴业银行股份有限公司

下属两级基金的基金简称 工银60天理财债券A

工银60天理财债券B

报告期末下属两级基金的份额总额 519,882,172.53份

42,111,932.57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60天理财债券A 工银60天理财债券B

1.本期已实现收益 7,565,316.08 1,740,893.76

2.本期利润 7,565,316.08 1,740,893.76

3.期末基金资产净值 519,882,172.53 42,111,932.57

注:(1)本基金基金资产分配是按日计提份额。

(2)所列数据截止至2013年12月31日。

(3)上表所列基金业绩不包括任何认购或申购基金的多项费用，计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

(4)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，由于货币市场基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益暂不列入利润。

注:(5)本基金合同生效日为2013年1月28日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 报告期期间基金净值收益变化与其同期业绩比较基准收益率的比较

工银60天理财债券A

工银60天理财债券B

过去三个月 1.1628% 0.0020% 0.3403% 0.0000% 0.8226% 0.0020%

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

工银60天理财债券A

工银60天理财债券B

过去三个月 1.1628% 0.0020% 0.3403% 0.0000% 0.8226% 0.0020%

注:上表中,基金的本期份额净值和净值增长率为人民币元/份。

6.5.2 报告期内按基金的资产净值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号 债券代码 债券名称 债券数量(张) 摆余成本(元) 占基金资产净值比例(%)

1 13鲁安桥CP001 国家债券 500,000 49,964,231.17 8.89

2 13国投CP001 央行票据 500,000 49,628,821.03 8.83

3 13麦纺001 金融债券 300,000 30,011,572.64 5.34

4 13沙钢001 企业债券 300,000 29,994,933.79 5.34

5 13新余钢铁CP001 企业债券 300,000 29,990,236.57 5.34

6 13华宏债 企业债券 300,000 29,982,518.36 5.34

7 13华业CP002 企业债券 300,000 29,912,245.40 5.32

8 13中材001 中期票据 200,000 20,001,517.63 3.56

9 13建投CP001 债券 200,000 20,000,630.22 3.56

10 13交控CP001 债券 200,000 20,000,598.52 3.56

注:上表中,债券的本期包含债券面值和折溢价;

6.5.3 报告期内按债券品种平均剩余期限分布比例

序号 平均剩余期限(天) 各期限占基金资产净值的比例(%)

1 30天以内 2.05 33.35

其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 - -

2 30(含)-60天 3.54 -

其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 - -

3 60(含)-90天 14.23 -

其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 - -

4 90(含)-180天 71.44 -

其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 - -

5 180(含)-397天(含) 48.02 -

其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 - -

6 397天以上(含) 139.28 33.35

注:(1)本基金基金资产分配是按日计提份额。

(2)所列数据截止至2013年12月31日。

(3)上表所列基金业绩不包括任何认购或申购基金的多项费用，计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

(4)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，由于货币市场基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益暂不列入利润。

(5)本基金合同生效日为2013年1月28日。

3.2.3 报告期期间基金净值收益变化与其同期业绩比较基准收益率的比较

工银60天理财债券A

工银60天理财债券B

过去三个月 1.1628% 0.0020% 0.3403% 0.0000% 0.8226% 0.0020%

注:上表中,基金的本期包含债券面值和折溢价;

6.5.4 报告期内按债券品种平均剩余期限分布比例

序号 债券品种 平均剩余期限(天) 各期限占基金资产净值的比例(%)

1 国家债券 30天以内 65.63

其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 - -

2 企业债券 30(含)-60天 7.21 -

其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 - -

3 中期票据 60(含)-90天 24.13 -

其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 - -

4 短期融资券 90(含)-180天 5.99 -

其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 - -

5 超短期融资券 180天(含)-397天(含) 102.96 -

其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 - -

6 利率债 - -

注:(1)本基金基金资产分配是按日计提份额。

(2)所列数据截止至2013年12月31日。

(3)上表所列基金业绩不包括任何认购或申购基金的多项费用，计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

(4)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，由于货币市场基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益暂不列入利润。

(5)本基金合同生效日为2013年1月28日。

3.2.4 报告期期间基金净值收益变化与其同期业绩比较基准收益率的比较

工银60天理财债券A

工银60天理财债券B

过去三个月 1.1628% 0.0020% 0.3403% 0.0000% 0.8226% 0.0020%

注:上表中,基金的本期包含债券面值和折溢价;

6.5.5 报告期内按债券品种平均剩余期限分布比例

序号 债券品种 平均剩余期限(天) 各期限占基金资产净值的比例(%)

1 国家债券 30天以内 65.63

其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 - -

2 企业债券 30(含)-60天 7.21 -

其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 - -

3 中期票据 60(含)-90天 24.13 -

其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 - -

4 短期融资券 90(含)-180天 5.99 -

其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 - -

5 超短期融资券 180天(含)-397天(含) 102.96 -

其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 - -

6 利率债 - -

注:(1)本基金基金资产分配是按日计提份额。

(2)所列数据截止至2013年12月31日。

(3)上表所列基金业绩不包括任何认购或申购基金的多项费用，计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

(4)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，由于货币市场基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益暂不列入利润。

(5)本基金合同生效日为2013年1月28日。

3.2.5 报告期期间基金净值收益变化与其同期业绩比较基准收益率的比较

工银60天理财债券A

工银60天理财债券B

过去三个月 1.1628% 0.0020% 0.3403% 0.0000% 0.8226% 0.0020%

注:上表中,基金的本期包含债券面值和折溢价;

6.5.6 报告期内按债券品种平均剩余期限分布比例

序号 债券品种 平均剩余期限(天) 各期限占基金资产净值的比例(%)

1 国家债券 30天以内 65.63

其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 - -

2 企业债券 30(含)-60天 7.21 -

其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 - -

3 中期票据 60(含)-90天 24.13 -

其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 - -

4 短期融资券 90(含)-180天 5.99 -

其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 - -

5 超短期融资券 180天(含)-397天(含) 102.96 -

其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 - -

6 利率债 - -

注:(1)本基金基金资产分配是按日计提份额。

(2)所列数据截止至2013年12月31日。

(3)上表所列基金业绩不包括任何认购或申购基金的多项费用，计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

(4)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，由于货币市场基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益暂不列入利润。

(5)本基金合同生效日为2013年1月28日。

3.2.6 报告期期间基金净值收益变化与其同期业绩比较基准收益率的比较

工银60天理财债券A

工银60天理财债券B