

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
送达日期:2014年3月31日

重要提示

基金管理人的董事、董事会秘书或高级管理人员在签署文件时,承担勤勉尽责或重大遗漏,并对内容的准确性、真实性、完整性承担责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字并经监事会同意,由监事会签章。

基金托管人对本报告书披露的财务信息进行复核,确认报告书不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

基金管理人以诚实信用、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。

基金合同生效后并不代表其未来持续盈利,投资者购买本基金前应仔细阅读本基金的招募说明书及其摘要。

本年度报告所载摘要来自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告期间自2013年8月14日(基金合同生效日)起至2013年12月31日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况	
基金简称	工银瑞信月薪定期支付债券型证券投资基金
基金代码	100026
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
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
报告期末基金总资产	3,024,200,543.54
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明	
投资目标	在控制风险并保持资产流动性的基础上,通过配置债券等固定收益类金融产品,实现基金资产的稳定增值。
投资策略	本基金在资产配置的基础上,通过分析不同投资品种的收益率差,根据宏观经济形势、资金面情况、利率走势、信用利差、流动性等因素,在严格控制风险的前提下,精选具有投资价值的债券品种,以期获得稳定的资本增值。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为:三年期定期存款基准收益率(税后)+1.5%。
风险收益特征	本基金为债券型基金,风险低于股票型基金,风险高于货币市场基金。根据《基金合同》约定,本基金的风险评级为R2级。

2.3 基金管理人和基金托管人	
基金管理人	工银瑞信基金管理有限公司
名称	交通银行股份有限公司
姓名	朱鹤艳
信息披露负责人	朱鹤艳
联系电话	400-811-9999
电子邮箱	customerservice@icbccs.com.cn
客户服务电话	400-811-9999
传真	010-66583158
报告期	021-62701216

2.4 信息披露方式	
基金份额净值公告正刊登载于互联网网址	www.icbccs.com.cn
基金份额净值公告发布地点	基金管理人和基金托管人的住所

2.5 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	
金额单位:人民币元	

3.1 本期期间数据和指标	
2013年8月14日(基金合同生效日)-2013年12月31日	
本期已实现收益	55,289,146.80
本期利润	4,585,192.89
加权平均基金份额本期利润	0.0014
本期基金份额净值增长率	0.10%
2013年末	
当年可供分配基金份额利润	0.0012
期末基金份额净值	3,027,773,667.01
基金份额净值增长率	1.00%

注:1. 所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. 本期已实现收益指扣除本期利息收入, 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, 本报告期利润即本期已实现收益加上本期公允价值变动收益;
3. 本基金基金合同生效日为2013年8月14日。截至报告期末, 本基金基金合同生效不满一年。

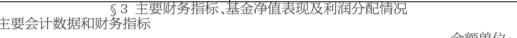
3.2 基金净值表现

3.2.1 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	份额净值增长 率(年化收益率) (%)	净值收益率 差额(%)	基准收益率 差额(%)	①-③	②-④
过去三个月	-40.40%	0.07%	1.45%	0.02%	-1.85%
自基金合同生 效至今	6.10%	0.06%	2.21%	0.02%	-2.11%

注:本基金基金合同生效日为2013年8月14日。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动与其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2013年8月14日生效, 截至报告期末, 本基金基金合同生效不满一年。
2. 按基金合同规定, 本基金合计持有100%的现金资产, 其中现金占总资产的比例不超过5%, 剩余持有或现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不超过5%。
3. 本基金基金合同生效日为2013年8月14日。截至报告期末, 本基金基金合同生效不满一年。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

自基金成立以来未发生利润分配情况。

3.4 管理人报告

4. 基金管理人及基金经理情况

4.1 基金管理人及基金经理的基本情况

4.1.1 基金管理人概况

4.1.2 基金经理

4.1.3 基金经理的证券投资经历

4.1.4 基金经理的过往管理业绩

4.1.5 基金经理的诚信合规情况

4.1.6 基金经理的其他情况

4.2 基金管理人对旗下基金履行持续义务的情况

4.2.1 基金管理人对旗下基金履行的管理义务

4.2.2 基金管理人对旗下基金履行的托管义务

4.2.3 基金管理人对旗下基金履行的监察稽核义务

4.2.4 基金管理人对旗下基金履行的信息披露义务

4.2.5 基金管理人对旗下基金履行的客户服务义务

4.2.6 基金管理人对旗下基金履行的其他义务

4.3 基金管理人对旗下基金履行的公平交易义务

4.3.1 公平交易制度和控制方法

4.3.2 公平交易执行情况

4.3.3 公平交易制度执行情况

4.3.4 公平交易制度执行情况的专项说明

4.3.5 公平交易制度执行情况的定期报告

4.3.6 公平交易制度执行情况的年度报告

4.3.7 公平交易制度执行情况的半年度报告

4.3.8 公平交易制度执行情况的季度报告

4.3.9 公平交易制度执行情况的月度报告

4.3.10 公平交易制度执行情况的临时报告

4.3.11 公平交易制度执行情况的定期报告

4.3.12 公平交易制度执行情况的年度报告

4.3.13 公平交易制度执行情况的半年度报告

4.3.14 公平交易制度执行情况的季度报告

4.3.15 公平交易制度执行情况的月度报告

4.3.16 公平交易制度执行情况的临时报告

4.3.17 公平交易制度执行情况的定期报告

4.3.18 公平交易制度执行情况的年度报告

4.3.19 公平交易制度执行情况的半年度报告

4.3.20 公平交易制度执行情况的季度报告

4.3.21 公平交易制度执行情况的月度报告

4.3.22 公平交易制度执行情况的临时报告

4.3.23 公平交易制度执行情况的定期报告

4.3.24 公平交易制度执行情况的年度报告

4.3.25 公平交易制度执行情况的半年度报告

4.3.26 公平交易制度执行情况的季度报告

4.3.27 公平交易制度执行情况的月度报告

4.3.28 公平交易制度执行情况的临时报告

4.3.29 公平交易制度执行情况的定期报告

4.3.30 公平交易制度执行情况的年度报告

4.3.31 公平交易制度执行情况的半年度报告

4.3.32 公平交易制度执行情况的季度报告

4.3.33 公平交易制度执行情况的月度报告

4.3.34 公平交易制度执行情况的临时报告

4.3.35 公平交易制度执行情况的定期报告

4.3.36 公平交易制度执行情况的年度报告

4.3.37 公平交易制度执行情况的半年度报告

4.3.38 公平交易制度执行情况的季度报告

4.3.39 公平交易制度执行情况的月度报告

4.3.40 公平交易制度执行情况的临时报告

4.3.41 公平交易制度执行情况的定期报告

4.3.42 公平交易制度执行情况的年度报告

4.3.43 公平交易制度执行情况的半年度报告

4.3.44 公平交易制度执行情况的季度报告

4.3.45 公平交易制度执行情况的月度报告

4.3.46 公平交易制度执行情况的临时报告

4.3.47 公平交易制度执行情况的定期报告

4.3.48 公平交易制度执行情况的年度报告

4.3.49 公平交易制度执行情况的半年度报告

4.3.50 公平交易制度执行情况的季度报告

4.3.51 公平交易制度执行情况的月度报告

4.3.52 公平交易制度执行情况的临时报告

4.3.53 公平交易制度执行情况的定期报告

4.3.54 公平交易制度执行情况的年度报告

4.3.55 公平交易制度执行情况的半年度报告</