

工银瑞信信用纯债债券型证券投资基金

2014 年度报告摘要

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

债券代码	项目	金额	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	1,630,414,186.84	93.91
其中：债券	1,630,414,186.84	93.91	
3	资产支持证券	-	-
4	金融衍生投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
其中：买断式回购买入返售金融资产	-	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	68,707,934.76	3.96
7	其他各项资产	37,096,917.57	2.14
8	合计	1,736,219,093.17	100.00

注:由于四舍五入的原因基金总金额占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差;

7.2 期末行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

7.3 期间按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出现期基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期无累计买入股票的金额。

7.4.2 累计买入股票的金额及买入股票的收入总额

本基金本报告期无买入股票的交易量。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	100,953,000.00	9.31
4	企业债券	99,078,186.84	91.17
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	20,112,000.00	1.85
7	短期融资券	520,271,000.00	47.95
8	其他	-	-
9	合计	1,630,414,186.84	100.00

注:由于四舍五入的原因公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差;

7.6 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

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	121461	13贴水票	649,990	63,439,024.00	5.85
2	140208	14开08	500,000	50,850,000.00	4.69
3	138023	13贴EMTN	500,000	48,920,000.00	4.51
4	138036	13鲁鲁MTN1	500,000	48,240,000.00	4.45
5	138068	13浦浦MTN1	400,000	40,204,000.00	3.71

注:由于四舍五入的原因公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差;

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名货币市场基金投资明细

本基金本报告期末未持有货币市场基金。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名国债期货投资明细

本基金本报告期末未持有国债期货投资。

7.10 本期国债期货投资政策

本期没有国债期货投资。

7.10.9 本期末基金持有的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货投资,也无期间损益。

7.10.10 本期国债期货投资评价

无。

7.11 投资组合报告附注

7.11.8 本期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、处罚的情形。

7.11.9 本期投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.11.10 本期其他各项资产构成

金额单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	45,147.50
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	37,096,917.57
5	应收申购款	12,484.12
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	37,096,917.57

注:由于四舍五入的原因公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差;

7.11.11 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处于转股期的可转换债券。

7.11.12 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

7.11.13 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

序号	持有人户数(户)	户均持有的基金份额数(份)	持有人结构		
			机构投资者	个人投资者	占比
1	1,590	276,625.54	357,634,218.20	81.31%	82,200,390.34
2	2,192	277,699.60	416,728,290.05	68.46%	191,989,230.78
3	3,782	277,248.05	774,362,598.21	73.85%	274,189,621.12

注:1.基金持有人数按单个账户统计;2.机构投资者包括企业、事业单位、社会团体、基金业协会等组织以及合格境外机构投资者。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

份额单位:份

注:1.基金管理人本期末未持有本基金。

2.本公司高级管理人员、基金经理等人员持有本基金。

3.本公司督察长未持有本基金。

4.本公司股东未持有本基金。

5.本公司实际控制人未持有本基金。

6.本公司股东的法定代表人未持有本基金。

7.本公司股东的高级管理人员未持有本基金。

8.本公司股东的基金经理未持有本基金。

9.本公司股东的督察长未持有本基金。

10.本公司股东的法定代表人未持有本基金。

11.本公司股东的高级管理人员未持有本基金。

12.本公司股东的基金经理未持有本基金。

13.本公司股东的督察长未持有本基金。

14.本公司股东的法定代表人未持有本基金。

15.本公司股东的高级管理人员未持有本基金。

16.本公司股东的基金经理未持有本基金。

17.本公司股东的督察长未持有本基金。

18.本公司股东的法定代表人未持有本基金。

19.本公司股东的高级管理人员未持有本基金。

20.本公司股东的基金经理未持有本基金。

21.本公司股东的督察长未持有本基金。

22.本公司股东的法定代表人未持有本基金。

23.本公司股东的高级管理人员未持有本基金。

24.本公司股东的基金经理未持有本基金。

25.本公司股东的督察长未持有本基金。

26.本公司股东的法定代表人未持有本基金。

27.本公司股东的高级管理人员未持有本基金。

28.本公司股东的基金经理未持有本基金。

29.本公司股东的督察长未持有本基金。

30.本公司股东的法定代表人未持有本基金。

31.本公司股东的高级管理人员未持有本基金。

32.本公司股东的基金经理未持有本基金。

33.本公司股东的督察长未持有本基金。

34.本公司股东的法定代表人未持有本基金。

35.本公司股东的高级管理人员未持有本基金。

36.本公司股东的基金经理未持有本基金。

37.本公司股东的督察长未持有本基金。

38.本公司股东的法定代表人未持有本基金。

39.本公司股东的高级管理人员未持有本基金。

40.本公司股东的基金经理未持有本基金。

41.本公司股东的督察长未持有本基金。

42.本公司股东的法定代表人未持有本基金。

43.本公司股东的高级管理人员未持有本基金。

44.本公司股东的基金经理未持有本基金。

45.本公司股东的督察长未持有本基金。

46.本公司股东的法定代表人未持有本基金。

47.本公司股东的高级管理人员未持有本基金。

48.本公司股东的基金经理未持有本基金。

49.本公司股东的督察长未持有本基金。

50.本公司股东的法定代表人未持有本基金。

51.本公司股东的高级管理人员未持有本基金。

52.本公司股东的基金经理未持有本基金。

53.本公司股东的督察长未持有本基金。

54.本公司股东的法定代表人未持有本基金。

55.本公司股东的高级管理人员未持有本基金。

56.