工银瑞信四季收益债券型证券投资基金（LOF）

【2014】第三季度报告

基金管理人：工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人：中国农业银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一四年十月二十七日

§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本基金合同规定，于2014年10月23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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	工银四季收益债券
场内简称	工银四季
交易代码	164808
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）
基金合同生效日	2014年2月10日
报告期末基金份额总额	2,624,393,269.17份
投资目标	在严格控制风险与保持资产流动性的基础上，追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金在深入分析固定收益品种的投资价值的基础上，采用久期管理等组合管理策略，构建债券组合，通过重点投资公司债、企业债等企业机构发行的固定收益金融工具，以获取相对稳定的基础收益；同时，通过新股申购、增发新股、可转换债券转股票、权证行权以及要约收购类股票套利等投资方式来提高基金收益水平。
业绩比较基准	三年期定期存款利率+1.8%。
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于低风险基金产品，其长期平均风险和预期收益率低于混合型基金，高于货币市场基金。在债券型基金产品中，本基金主要投资于公司债、企业债、短期融资券、商业银行金融债与次级债、企业资产支持证券、可转换债券（含分离交易的可转换债券）等企业机构发行的债券，其长期平均风险程度和预期收益率高于普通债券型基金。
基金管理人	工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

§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

主要财务指标	报告期（2014年7月1日 - 2014年9月30日）
1.本期已实现收益	21,918,524.37
2.本期利润	54,379,015.70
3.加权平均基金份额本期利润	0.0381
4.期末基金资产净值	2,821,106,937.89
5.期末基金份额净值	1.075

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。

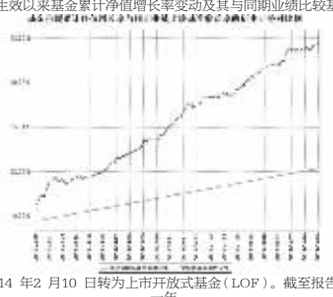
（3）所列数据截止到2014年9月30日。

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

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	3.36%	0.11%	1.52%	0.01%	1.84%	0.10%

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



注：1、本基金于2014年2月10日转为上市开放式基金（LOF）。截至报告期末，本基金转型不满一年。

2、根据基金合同的规定，本基金的建仓期为6个月。截至报告期末，本基金投资比例符合基金合同关于投资比例的各项约定：本基金投资债券等固定收益类资产占基金资产的比例不低于80%；其中公司债、企业债、短期融资券、商业银行金融债与次级债、企业资产支持证券、可转换债券（含分离交易的可转换债券）等企业机构发行的债券占基金固定收益类资产的比例不低于80%；股票等权益类资产占基金资产的比例不超过20%。本基金转换为开放式基金（LOF）以后，基金持有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%。

3.3 其他指标

无。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
何秀红	固定收益部副总监，本基金的基金经理	2011年2月10日	-	7	曾任广发证券股份有限公司债券研究员；2009年加入工银瑞信，现任固定收益部副总监；2011年2月10日至今，担任工银四季收益债券型基金基金经理；2011年12月27日至今担任工银保本混合基金基金经理；2012年11月14日至今担任工银信用纯债债券基金基金经理；2013年3月29日至今，担任工银瑞信产业债债券基金基金经理；2013年5月22日至今，担任工银信用纯债一年定期开放基金基金经理；2013年6月24日起至今，担任工银信用纯债两年定期开放基金基金经理。
江明波	投资总监，本基金的基金经理。	2011年2月10日	-	14	曾任鹏华基金普天债券基金经理，固定收益负责人；2004年6月至2006年12月，担任全国社保基金二零四组合和三零四组合基金经理；2006年加入工银瑞信，现任投资总监，兼任工银瑞信资产管理（国际）有限公司固定收益投资总监，工银瑞信投资管理有限公司董事；2011年起担任全国社保组合基金经理；2008年4月14日至今，担任工银添利基金基金经理；2011年2月10日至今，担任工银四季收益债券型基金基金经理；2013年3月6日至今，担任工银瑞信增利分级债券基金基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本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，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

为了公平对待各类投资人，保护各类投资人利益，避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为，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》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规和公司内部规章，拟定了《公平交易管理办法》、《异常交易管理办法》，对公司管理的各类资产的公平对待做了明确具体的规定，并规定对买卖股票、债券时候的价格和市场价格差距较大，可能存在操纵股价、利益输送等违法违规情况进行监控。本报告期，按照时间优先、价格优先的原则，本公司对满足限价条件且对同一证券有相同交易需求的基金等投资组合，均采用了系统中的公平交易模块进行操作，实现了公平交易；未出现清算不到位的情况，且本基金及本基金与本基金管理人管理的其他投资组合之间未发生法律法规禁止的反向交易及交叉交易。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内未出现异常交易的情况。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交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的5%。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

三季度，中国经济下行幅度略超出市场预期，国内需求很差，海外需求温和回升，导致贸易顺差大幅增加，然而居民结汇意愿低迷，外汇占款增长幅度较低。央行货币政策放松幅度加大，正回购利率下调且启动SLF等工具释放流动性。然而，融资增速仍然低迷，尤其是表外融资基本停滞，我们猜测与地产行业收缩以及银监会对银行表外业务的监管有关系。基本面环境和政策环境均有利于债券市场走牛，收益率曲线出现平坦化下行。流动性好转结合政府对于公开债务维护使得信用利差收缩，城投债利差达到历史最低水平，高收益产业债利差也大幅收敛。尽管经济仍然下行，然而权益市场表现非常不错，流动性充裕以及投资者对于经济有底预期和改革预期，股票市场出现较大幅度上涨，可转债市场表现跟随正股上涨，表现也非常不错。

四季收益规模大幅增长，逐渐买入3年以内信用债和可转债。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内本基金净值增长率3.36%，业绩比较基准收益率为1.52%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

四季度，中国经济将出现企稳迹象，主要原因在于一系列放松政策将逐渐发生作用，货币政策放松与房地产政策放松将支持地产销售见底回升。投资者对于经济预期将会有所上升，但是资金面仍然维持宽松，收益率曲线将呈现陡峭化。由于流动性保持宽裕，信用利差将维持低位。股票市场风险不大，流动性宽裕以及经济企稳对市场有支持，可转债经过三季度上涨基本丧失债性，与正股联动增大，尽管我们认为风险不大，然而由于安全性下降，仍然要控制仓位，寻找止盈时点。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	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	3,861,545,290.58	92.54
	其中：债券	3,861,545,290.58	92.54
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	44,762,693.70	1.07
7	其他资产	266,512,953.26	6.39
8	合计	4,172,820,937.54	100.00

注：由于四舍五入的原因金额占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	36,188,882.00	1.28
2	央行票据	-	-
3	金融债券	361,370,000.00	12.81
	其中：政策性金融债	361,370,000.00	12.81
4	企业债券	1,619,211,496.40	57.40
5	企业短期融资券	522,881,000.00	18.53
6	中期票据	890,037,000.00	31.55
7	可转债	431,856,912.18	15.31
8	其他	-	-
9	合计	3,861,545,290.58	136.88

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。

5.5 报告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

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	110023	民生转债	1,608,160	150,459,449.60	5.33
2	1082183	10首钢MTN2	1,000,000	99,540,000.00	3.53
3	140216	14国开16	900,000	90,027,000.00	3.19
4	122579	09远洋债	714,410	71,583,882.00	2.54
5	140220	14国开20	700,000	70,364,000.00	2.49

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

本报告期内，本基金未运用国债期货进行投资。

5.9.2 报告期末本基金投资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。

5.9.3 本期国债期货投资评价

本报告期内，本基金未运用国债期货进行投资。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 本基金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。

5.10.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	82,373.66
2	应收证券清算款	115,813,318.91
3	应收股利	-
4	应收利息	79,310,273.52
5	应收申购款	71,306,987.17
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	266,512,953.26

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110023	民生转债	150,459,449.60	5.33
2	110017	中海转债	55,811,184.00	1.98
3	110020	南山转债	42,753,800.00	1.52
4	125089	深机转债	39,962,346.84	1.42
5	110015	石化转债	33,176,738.70	1.18
6	113005	平安转债	25,173,500.00	0.89
7	110011	歌华转债	15,545,400.00	0.55
8	110012	海运转债	15,500,926.10	0.55
9	113006	深燃转债	8,365,600.00	0.30
10	110022	同仁转债	6,260,500.00	0.22

5.10.5 报告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。

5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	692,911,097.55
报告期期间基金总申购份额	2,229,349,803.32
减：报告期期间基金总赎回份额	297,867,631.70
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	-
报告期期末基金份额总额	2,624,393,269.17

注：1.报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额；

2.报告期期间基金总赎回份额含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准工银瑞信四季收益债券型证券投资基金（LOF）设立的文件；

2、《工银瑞信四季收益债券型证券投资基金（LOF）基金合同》；

3、《工银瑞信四季收益债券型证券投资基金（LOF）托管协议》；

4、基金管理人业务资格批件和营业执照；

5、基金托管人业务资格批件和营业执照；

6、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

9.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的住所。

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅。也可在支付工本费后，在合理时间内取得上述文件的复印件。

工银瑞信信息产业股票型证券投资基金

【2014】第三季度报告

基金管理人：工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人：中国农业银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一四年十月二十七日

§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本基金合同规定，于2014年10月23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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	工银信息产业股票
交易代码	000263
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年11月11日
报告期末基金份额总额	1,085,584,662.82份
投资目标	分析信息产业的变化趋势和新技术的发展方向，前瞻性地把握信息产业内通过研发不断创造出新的市场需求，并通过选择具有领先优势、创新能力及成长潜力良好的上市公司进行投资，在控制投资风险的同时，力争通过主动管理实现超越业绩基准的收益。
投资策略	本基金的资产配置策略主要是通过对宏观经济周期运行规律的研究，基于定量与定性相结合的宏观及市场分析，确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例，规避系统性风险。
业绩比较基准	80%×中证TMT产业主题指数收益率+20%×上证国债指数收益率
风险收益特征	本基金是股票型基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金、债券型基金与混合型基金，属于风险水平较高的基金。本基金主要投资于信息产业股票，其风险高于全市场范围内投资的股票型基金。
基金管理人	工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

§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

主要财务指标	报告期（2014年7月1日 - 2014年9月30日）
1.本期已实现收益	145,241,150.27
2.本期利润	218,284,432.34
3.加权平均基金份额本期利润	0.3012
4.期末基金资产净值	1,596,008,676.34
5.期末基金份额净值	1.470

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”。

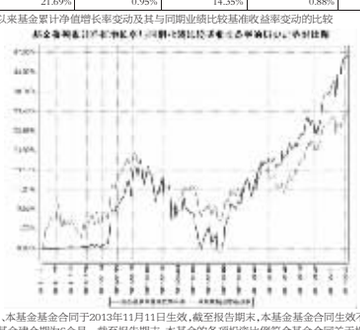
3、所列数据截止到2014年9月30日。

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

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	21.69%	0.95%	14.35%	0.88%	7.34%	0.07%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与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11月11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，本基金建仓期为6个月。截至报告期末，本基金的各项投资比例符合基金合同关于投资范围及投资限制的规定：股票资产占基金资产的比例不低于60%，债券等固定收益类资产占基金资产的比例为5%-40%。其中，本基金投资于基金合同界定的信息产业股票资产占非现金基金资产的比例不低于80%，任何交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

3.3 其他指标

无。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘天任	本基金的基金经理	2013年11月11日	-	6	曾任埃森哲咨询公司资深分析员。2008年加入工银瑞信，曾任研究部高级研究员；2013年11月11日至今，担任工银瑞信信息产业股票型基金基金经理；2014年6月5日至今，担任工银瑞信稳健成长股票基金基金经理。
王烁杰	本基金的基金经理	2014年4月28日	-	4	先后在中国移动北京分公司担任行业分析经理，在中邮创业基金担任行业研究员；2011年加入工银瑞信，曾任研究部研究员，2014年4月28日至今，担任工银瑞信信息产业股票型基金基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本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，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

为了公平对待各类投资人，保护各类投资人利益，避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为，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》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规和公司内部规章，拟定了《公平交易管理办法》、《异常交易管理办法》，对公司管理的各类资产的公平对待做了明确具体的规定，并规定对买卖股票、债券时候的价格和市场价格差距较大，可能存在操纵股价、利益输送等违法违规情况进行监控。本报告期，按照时间优先、价格优先的原则，本公司对满足限价条件且对同一证券有相同交易需求的基金等投资组合，均采用了系统中的公平交易模块进行操作，实现了公平交易；未出现清算不到位的情况，且本基金及本基金与本基金管理人管理的其他投资组合之间未发生法律法规禁止的反向交易及交叉交易。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内未出现异常交易的情况。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交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的5%。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

三季度，中国经济下行幅度略超出市场预期，国内需求很差，海外需求温和回升，导致贸易顺差大幅增加，然而居民结汇意愿低迷，外汇占款增长幅度较低。央行货币政策放松幅度加大，正回购利率下调且启动SLF等工具释放流动性。然而，融资增速仍然低迷，尤其是表外融资基本停滞，我们猜测与地产行业收缩以及银监会对银行表外业务的监管有关系。基本面环境和政策环境均有利于债券市场走牛，收益率曲线出现平坦化下行。流动性好转结合政府对于公开债务维护使得信用利差收缩，城投债利差达到历史最低水平，高收益产业债利差也大幅收敛。尽管经济仍然下行，然而权益市场表现非常不错，流动性充裕以及投资者对于经济有底预期和改革预期，股票市场出现较大幅度上涨，可转债市场表现跟随正股上涨，表现也非常不错。

四季收益规模大幅增长，逐渐买入3年以内信用债和可转债。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内本基金净值增长率3.36%，业绩比较基准收益率为1.52%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

四季度，中国经济将出现企稳迹象，主要原因在于一系列放松政策将逐渐发生作用，货币政策放松与房地产政策放松将支持地产销售见底回升。投资者对于经济预期将会有所上升，但是资金面仍然维持宽松，收益率曲线将呈现陡峭化。由于流动性保持宽裕，信用利差将维持低位。股票市场风险不大，流动性宽裕以及经济企稳对市场有支持，可转债经过三季度上涨基本丧失债性，与正股联动增大，尽管我们认为风险不大，然而由于安全性下降，仍然要控制仓位，寻找止盈时点。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	1,372,679,155.42	78.10
	其中：股票	1,372,679,155.42	78.10
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	299,629,804.12	17.05
7	其他资产	85,178,936.16	4.85
8	合计	1,757,487,895.70	100.00

注：由于四舍五入的原因金额占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	28,242,532.43	1.77
B	采矿业	446.32	0.00
C	制造业	629,752,685.78	39.46
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	101,506,340.33	6.36
E	建筑业	1,958.88	0.00
F	批发和零售业	18.46	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	535,263,476.78	33.54
J	金融业	13,729,523.06	0.86
K	房地产业	12,810,690.00	0.80
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	19,662,513.94	1.23
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	31,708,969.44	1.99
	合计	1,372,679,155.42	86.01

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。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300213	佳讯飞鸿	3,443,973	78,488,144.67	4.92
2	002279	久其软件	2,233,257	73,987,804.41	4.64
3	300188	美亚柏科	1,890,777	72,700,375.65	4.56
4	600505	西昌电力	6,469,618	69,936,570.58	4.38
5	300288	朗玛信息	619,523	68,494,462.88	4.29
6	002520	日发精机	2,584,587	67,612,795.92	4.24
7	002373	千方科技	2,664,877	66,355,437.30	4.16
8	300392	腾信股份	635,875	64,299,680.00	4.03
9	300093	金刚玻璃	3,920,458	55,748,912.76	3.49
10	000403	*ST生化	2,207,723	50,888,015.15	3.19

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告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

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货投资，也无期间损益。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本报告期内，本基金未运用股指期货进行投资。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本报告期内，本基金未运用国债期货进行投资。

5.10.2 报告期末本基金投资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。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本报告期内，本基金未运用国债期货进行投资。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的投资决策程序说明：

根据振兴生化2013年10月16日公告，公司存在下列违规行为：

1. 关联担保未履行审议程序和披露义务

2006年6月29日，振兴电业与中国银行运城分行签订了2006年振兴抵字03号《最高额抵押合同》，并在河津市工商行政管理局就振兴电业6.34亿元的固定资产办理了抵押登记（河工商河押字第06014号《抵押物登记证》）。上述为关联人签订担保合同以及主要资产被办理抵押登记的情况，振兴生化未履行审议程序，也未及时披露，直到2013年5月6日在本所的监管要求下，才发布《关于对外担保情况的自查公告》。

2. 重大诉讼未履行披露义务

2012年5月，因山西振兴集团未能偿还借款本金及利息，债权人向法院起诉山西振兴集团以及四位担保人振兴电业、振兴集团、史跃武和山西振兴集团铝业公司，诉讼金额约6.86亿元，涉及振兴电业的诉讼请求是，在担保范围内承担担保责任，并对2006年振兴抵字03号《最高额抵押合同》项下的抵押物优先受偿。上述诉讼事件发生后，振兴生化未及时履行披露义务，直到2013年4月24日才发布重大诉讼提示性公告。对此，振兴生化对外公告称是因振兴集团未及时向其转交相关诉讼材料，导致其未能及时履行披露义务。

3. 对外财务资助未履行审议程序和披露义务

自2009年3月，振兴生化子公司广东双林生物制药有限公司（以下简称“广东双林”）开始与山西离石市企业家李志强合作共同投资设立单采血浆有限公司（站）。截至2012年底，双方共设立了5家单采血浆有限公司（站）。在此过程中，广东双林为李志强提供借款以及其他财务资助形式共约0.24亿元。对上述财务资助行为，振兴生化未履行董事会审议程序和披露义务。

4. 未按规定做好投资者关系管理工作

2013年以来，投资者多次投诉振兴生化不接咨询电话，也不及时回答投资者在本所“互动易”平台上的咨询问题。

5. 拒不配合深圳交易所监管工作。

2013年6月3日，深圳交易所向振兴生化发出年报问询函（（2013）第384号），明确要求振兴生化于6月5日前回复。其后，尽管本所相关人员多次催促，但振兴生化直到6月28日才提交回复，且未严格按照问询函要求回复相关问题，也未提交会计师专项说明、相关合同、单据等书面材料。7月10日，本所向其发出监管函（公司部监管函（2013）第59号），要求振兴生化于7月12日前严格按照本所问询函要求予以回复。尽管振兴生化再次提交回复，但因会计师与保荐机构就公司与振兴集团之间资金往来的相关意见相矛盾，振兴生化拖延提供回复函件以及会计师专项说明的盖章页，就至目前仍未提交相关文件的盖章页。

振兴生化的上述行为，违反了本所《股票上市规则（2008年修订）》第1.4条、第2.18条、第9.11条、第11.11.2条规定、本所《股票上市规则（2012修订）》第1.4条、第2.18条、第6.14条、第9.11条、第11.11.2条规定以及本所《主板上市公司规范运作指引》第8.12条的规定。

鉴于上述违规事实及情节，依据深圳证券交易所《股票上市规则（2012年修订）》第17.2条、第17.3条、第17.4条、第19.3条的相关规定，经深圳证券交易所纪律处分委员会审议通过，本所对振兴生化给予公开谴责的处分。

上述所列事项对公司的生产经营活动基本无影响。

5.11.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	970,904.46
2	应收证券清算款	45,243,361.12
3	应收股利	-
4	应收利息	60,219.53
5	应收申购款	38,904,451.05
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	85,178,936.16

5.11.4 报告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可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	348,152,170.73
报告期期间基金总申购份额	1,208,755,629.53
减：报告期期间基金总赎回份额	471,323,137.44
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	-
报告期期末基金份额总额	1,085,584,662.82

注：1.报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额；

2.报告期期间基金总赎回份额含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准工银瑞信信息产业股票型证券投资基金设立的文件；

2、《工银瑞信信息产业股票型证券投资基金合同》；

3、《工银瑞信信息产业股票型证券投资基金托管协议》；

4、基金管理人业务资格批件和营业执照；

5、基金托管人业务资格批件和营业执照；

6、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

9.2 存放地点

基金管理人或基金托管人住所。

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅。也可在支付工本费后，在合理时间内取得上述文件的复印件。

工银瑞信薪金货币市场基金

【2014】第三季度报告

基金管理人：工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人：交通银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一四年十月二十七日

§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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2014年10月23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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	工银薪金货币
交易代码	000528
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年1月27日
报告期末基金份额总额	16,186,143,633.23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。
投资策略	本基金将采取利率策略、信用策略、相对价值策略等积极投资策略，在严格控制风险的前提下，发掘和利用市场失衡提供的投资机会，实现组合增值。
业绩比较基准	中国人民银行公布的七天通知存款税后利率。
风险收益特征	本基金为货币市场基金，在所有证券投资基金中，是风险相对较低的基金产品。在一般情况下，其风险与预期收益均低于一般债券基金，也低于混合型基金与股票型基金。
基金管理人	工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
下属两级基金的基金简称	工银薪金货币A　工银薪金货币B
下属两级基金的交易代码	000528　000716
报告