

工银瑞信信用纯债债券型证券投资基金

[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的规定，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。

本报告期中财务数据未经审计。

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	工银信用纯债债券
交易代码	485119
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年11月14日
报告期末基金份额总额	1,322,657,108.36份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标	单位:人民币元
报告期(2014年7月1日 - 2014年9月30日)	
工银信用纯债债券 A	工银信用纯债债券 B
1.本期已实现收益	6,339,047.70
2.期初累计净值	9,176,179.21
3.报告期平均基金份额本期利润	0.0277
4.期末基金资产净值	912,056,536.47
5.期末基金份额净值	1.069

注:1.上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的费用，计算费用后实际收益水平将低于所示数字。
2.“本期已实现收益”指本基金本期利息收入、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。

§ 4 基金本期份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

工银信用纯债债券 A				
阶段	净值增长(%)	净值增长(%)	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率
①	2.89%	0.07%	1.16%	0.06%
过去三个月	2.71%	0.07%	1.16%	0.06%
			1.55%	0.01%
9	合计		1,960,593,385.65	139.27

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.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

5.1 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组合

序号	证券代码	证券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国泰保险		10,180,000	10,180,000.00	0.72
2	长丰控股		—	—	—
3	金融租赁		211,420,000.00	44,883,680.00	15.02
4	企业债券		211,420,000.00	44,883,680.00	15.02
5	企业债券		943,07,385.65	67,02	
6	中期票据		230,191,000.00	16,40	
7	可转债		564,667,000.00	40,11	
8	其他		—	—	—
9	合计		1,960,593,385.65	139.27	

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贵金属投资明细

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

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

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

5.9 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股指期货投资明细

5.10 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国债期货投资明细

5.11 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股票期权投资明细

5.12 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商品期货投资明细

5.13 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外汇投资明细

5.14 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其他金融工具投资明细

5.15 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衍生品投资明细

5.16 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买入返售金融资产投资明细

5.17 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卖出回购金融资产投资明细

5.18 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应收款项投资明细

5.19 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买入返售金融资产投资明细

5.20 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卖出回购金融资产投资明细

5.21 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应收款项投资明细

5.22 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买入返售金融资产投资明细

5.23 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卖出回购金融资产投资明细

5.24 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应收款项投资明细

5.25 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买入返售金融资产投资明细

5.26 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卖出回购金融资产投资明细

5.27 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应收款项投资明细

5.28 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买入返售金融资产投资明细

5.29 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卖出回购金融资产投资明细

5.30 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应收款项投资明细

5.31 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买入返售金融资产投资明细

5.32 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卖出回购金融资产投资明细

5.33 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应收款项投资明细

5.34 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买入返售金融资产投资明细

5.35 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卖出回购金融资产投资明细

5.36 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应收款项投资明细

5.37 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买入返售金融资产投资明细

5.38 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卖出回购金融资产投资明细

5.39 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应收款项投资明细

5.40 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买入返售金融资产投资明细

5.41 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卖出回购金融资产投资明细

5.42 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应收款项投资明细

5.43 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买入返售金融资产投资明细

5.44 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卖出回购金融资产投资明细

5.45 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应收款项投资明细

5.46 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买入返售金融资产投资明细

5.47 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卖出回购金融资产投资明细

5.48 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应收款项投资明细

5.49 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买入返售金融资产投资明细

5.50 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卖出回购金融资产投资明细

5.51 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应收款项投资明细

5.52 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买入返售金融资产投资明细

5.53 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卖出回购金融资产投资明细

5.54 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应收款项投资明细

5.55 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买入返售金融资产投资明细

5.56 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卖出回购金融资产投资明细

5.57 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应收款项投资明细

5.58 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买入返售金融资产投资明细

5.59 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卖出回购金融资产投资明细

5.60 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应收款项投资明细

5.61 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买入返售金融资产投资明细

5.62 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卖出回购金融资产投资明细

5.63 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应收款项投资明细

5.64 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买入返售金融资产投资明细

5.65 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卖出回购金融资产投资明细

5.66 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应收款项投资明细

5.67 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买入返售金融资产投资明细

5.68 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卖出回购金融资产投资明细

5.69 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应收款项投资明细

5.70 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买入返售金融资产投资明细

5.71 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卖出回购金融资产投资明细

5.72 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应收款项投资明细

5.73 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买入返售金融资产投资明细

5.74 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卖出回购金融资产投资明细

5.75 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