

工银瑞信添益快线货币市场基金

[2015] 第一季度报告

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:二〇一五年四月二十日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事、监事、高级管理人员和基金托管人不存在虚假记载、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2015年4月16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。

报告书中的财务数据未经审计。

本报告期2015年1月1日起至3月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	工银瑞信添益快线货币市场基金
交易代码	000848
基金合同生效日	2014年10月21日
基金份额净值	1.00
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

注:对于四舍五入的份额净值占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

§ 3 报告期内基金的业绩表现

本基金将采取滚动配置策略，利用策略、相对价值策略等和利差策略等投资策略，实现货币市场基金的规模、净值和收益的增值。

业绩比较基准：中国货币银行存款利率(税后)×80%+短期融资券利率(税后)×20%。

风险收益特征：本基金为货币市场基金，其风险和预期收益低于一般债券型基金，高于货币型基金。

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

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年1月1日-2015年3月31日)
1.本期已实现收益	761,083.60
2.本期利润	761,083.60
3.期末基金净值	104,523.42

注:(1)本基金收益分配是按日结转份额。

(2)所列数据截止到2015年3月31日。

(3)上述基金业报酬不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计算费用后实际收益水平要低于所列数字。

(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，本期利息收入为本期利息收入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，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金分位数净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 ① ② ③ ④

过去三个月 0.887% 0.001% 0.329% 0.000% 0.549% 0.001%

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

注:上图显示了基金份额净值与业绩比较基准的偏离情况。

6.6 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

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

1 140429 14农发29 100,000 10,135,152.52 9.57

2 011582011 15国开CP001 70,000 7,000,733.30 6.70

3 04155006 15国开CP002 70,000 6,997,233.73 6.69

4 011520020 15国开CP002 60,000 5,998,467.33 5.74

5 01159123 15大丰SCP001 40,000 3,999,020.85 3.83

注:上表中,债券的名称按公允价值和净值的偏离情况。

6.6.1 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

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

1 140429 14农发29 100,000 10,135,152.52 9.57

2 011582011 15国开CP001 70,000 7,000,733.30 6.70

3 04155006 15国开CP002 70,000 6,997,233.73 6.69

4 011520020 15国开CP002 60,000 5,998,467.33 5.74

5 01159123 15大丰SCP001 40,000 3,999,020.85 3.83

注:上表中,债券的名称按公允价值和净值的偏离情况。

6.6.2 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

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

1 140429 14农发29 100,000 10,135,152.52 9.57

2 011582011 15国开CP001 70,000 7,000,733.30 6.70

3 04155006 15国开CP002 70,000 6,997,233.73 6.69

4 011520020 15国开CP002 60,000 5,998,467.33 5.74

5 01159123 15大丰SCP001 40,000 3,999,020.85 3.83

注:上表中,债券的名称按公允价值和净值的偏离情况。

6.6.3 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

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

1 140429 14农发29 100,000 10,135,152.52 9.57

2 011582011 15国开CP001 70,000 7,000,733.30 6.70

3 04155006 15国开CP002 70,000 6,997,233.73 6.69

4 011520020 15国开CP002 60,000 5,998,467.33 5.74

5 01159123 15大丰SCP001 40,000 3,999,020.85 3.83

注:上表中,债券的名称按公允价值和净值的偏离情况。

6.6.4 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

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

1 140429 14农发29 100,000 10,135,152.52 9.57

2 011582011 15国开CP001 70,000 7,000,733.30 6.70

3 04155006 15国开CP002 70,000 6,997,233.73 6.69

4 011520020 15国开CP002 60,000 5,998,467.33 5.74

5 01159123 15大丰SCP001 40,000 3,999,020.85 3.83

注:上表中,债券的名称按公允价值和净值的偏离情况。

6.6.5 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

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

1 140429 14农发29 100,000 10,135,152.52 9.57

2 011582011 15国开CP001 70,000 7,000,733.30 6.70

3 04155006 15国开CP002 70,000 6,997,233.73 6.69

4 011520020 15国开CP002 60,000 5,998,467.33 5.74

5 01159123 15大丰SCP001 40,000 3,999,020.85 3.83

注:上表中,债券的名称按公允价值和净值的偏离情况。

6.6.6 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

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

1 140429 14农发29 100,000 10,135,152.52 9.57

2 011582011 15国开CP001 70,000 7,000,733.30 6.70

3 04155006 15国开CP002 70,000 6,997,233.73 6.69

4 011520020 15国开CP002 60,000 5,998,467.33 5.74

5 01159123 15大丰SCP001 40,000 3,999,020.85 3.83

注:上表中,债券的名称按公允价值和净值的偏离情况。

6.6.7 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

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

1 140429 14农发29 100,000 10,135,152.52 9.57

2 011582011 15国开CP001 70,000 7,000,733.30 6.70

3 04155006 15国开CP002 70,000 6,997,233.73 6.69

4 011520020 15国开CP002 60,000 5,998,467.33 5.74

5 01159123 15大丰SCP001 40,000 3,999,020.85 3.83

注:上表中,债券的名称按公允价值和净值的偏离情况。

6.6.8 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

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

1 140429 14农发29 100,000 10,135,152.52 9.57

2 011582011 15国开CP001 70,000 7,000,733.30 6.70

3 04155006 15国开CP002 70,000 6,997,233.73 6.69

4 011520020 15国开CP002 60,000 5,998,467.33 5.74

5 01159123 15大丰SCP001 40,000 3,999,020.85 3.83

注:上表中,债券的名称按公允价值和净值的偏离情况。

6.6.9 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

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

1 140429 14农发29