

工银瑞信目标收益一年定期开放债券型投资基金

[2015] 第二季度报告

基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人:上海浦东发展银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一五年七月二十一日

§ 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:上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年7月17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,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

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。

报告期自2015年4月1日起至6月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	工银瑞信目标收益一年定期开放债券
交易代码	000728
基金运作方式	契约型定期开放式
基金合同生效日	2014年8月12日
报告期末基金资产总额	807,456,337.09元
投资目标	在控制风险并保持资产流动性的基础上,力争实现超越业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金将综合运用配置调整策略、期限配置策略、票息策略和信用策略等投资方法,通过资产配置、期限配置、票息策略和信用策略等投资方法,实现本基金资产的增值。
业绩比较基准	银行存款利率(税后)+0.5%
风险收益特征	本基金为债券型基金,风险收益特征与货币基金、股票基金、债券基金、混合基金相比,风险水平较低。
基金管理人	工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司

§ 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4月1日—2015年6月30日)
1.本期实现收益	20,836,843.11
2.本期利润	24,464,317.30
3.期末平均基金份额利润	0.00303
4.期末基金资产净值	870,837,720.00
5.期末基金份额净值	1.078

注:(1)上述基金业绩指标不包括任何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基金的业绩指标。

(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利润。

(3)所列数据截止到2015年6月30日。

3.2.1 基金净值表现

3.2.1.1 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

注:由于四舍五入的原因基金净值占基金总资产的比例分之和与合计可能有尾差。

5.2 报告期未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

本基金本报告期末未持有股票。

5.3 报告期未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

5.4 报告期未按债券品种分类的债券投资组合

注:由于四舍五入的原因基金净值占基金总资产的比例分之和与合计可能有尾差。

5.5 报告期未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

5.6 报告期未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 报告期未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 报告期未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 报告期未按公允价值占基金的期货投资情况说明

5.9.1 本期期间国债投资情况说明

本报告期间,本基金未运用国债期货进行投资。

5.9.2 报告期末基金投资的国债期货持仓和盈亏明细

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 本期国债投资的评价情况

本报告期间,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 本基金持有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行政处罚的情形。

5.10.2 本报告期投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股库。

5.10.3 其他资产构成

注:由于四舍五入的原因基金净值占基金总资产的比例分之和与合计可能有尾差。

5.6 报告期未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 报告期未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 报告期未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 报告期未按公允价值占基金的期货投资情况说明

5.9.1 本期期间国债投资情况说明

本报告期间,本基金未运用国债期货进行投资。

5.9.2 报告期末基金投资的国债期货持仓和盈亏明细

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 本期国债投资的评价情况

本报告期间,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 本基金持有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行政处罚的情形。

5.10.2 本报告期投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股库。

5.10.3 其他资产构成

注:由于四舍五入的原因基金净值占基金总资产的比例分之和与合计可能有尾差。

5.6 报告期未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 报告期未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 报告期未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 报告期未按公允价值占基金的期货投资情况说明

5.9.1 本期期间国债投资情况说明

本报告期间,本基金未运用国债期货进行投资。

5.9.2 报告期末基金投资的国债期货持仓和盈亏明细

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 本期国债投资的评价情况

本报告期间,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 本基金持有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行政处罚的情形。

5.10.2 本报告期投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股库。

5.10.3 其他资产构成

注:由于四舍五入的原因基金净值占基金总资产的比例分之和与合计可能有尾差。

5.6 报告期未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 报告期未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 报告期未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 报告期未按公允价值占基金的期货投资情况说明

5.9.1 本期期间国债投资情况说明

本报告期间,本基金未运用国债期货进行投资。

5.9.2 报告期末基金投资的国债期货持仓和盈亏明细

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 本期国债投资的评价情况

本报告期间,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 本基金持有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行政处罚的情形。

5.10.2 本报告期投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股库。

5.10.3 其他资产构成

注:由于四舍五入的原因基金净值占基金总资产的比例分之和与合计可能有尾差。

5.6 报告期未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 报告期未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 报告期未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 报告期未按公允价值占基金的期货投资情况说明

5.9.1 本期期间国债投资情况说明

本报告期间,本基金未运用国债期货进行投资。

5.9.2 报告期末基金投资的国债期货持仓和盈亏明细

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 本期国债投资的评价情况

本报告期间,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 本基金持有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行政处罚的情形。

5.10.2 本报告期投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股库。

5.10.3 其他资产构成

注:由于四舍五入的原因基金净值占基金总资产的比例分之和与合计可能有尾差。

5.6 报告期未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 报告期未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 报告期未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 报告期未按公允价值占基金的期货投资情况说明

5.9.1 本期期间国债投资情况说明

本报告期间,本基金未运用国债期货进行投资。

5.9.2 报告期末基金投资的国债期货持仓和盈亏明细

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 本期国债投资的评价情况

本报告期间,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 本基金持有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行政处罚的情形。

5.10.2 本报告期投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股库。

5.10.3 其他资产构成

注:由于四舍五入的原因基金净值占基金总资产的比例分之和与合计可能有尾差。

5.6 报告期未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 报告期未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 报告期未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 报告期未按公允价值占基金的期货投资情况说明

5.9.1 本期期间国债投资情况说明

本报告期间,本基金未运用国债期货进行投资。

5.9.2 报告期末基金投资的国债期货持仓和盈亏明细

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 本期国债投资的评价情况

本报告期间,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 本基金持有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行政处罚的情形。