

工银瑞信增强收益债券型证券投资基金

[2015] 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:中银建信银行股份有限公司

报告送出日期:二〇一五年十月二十九日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事、监事和高级管理人员在履行职责时不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对本基金的真实性和准确性承担个别及连带责任。

基金托管人和基金销售机构在履行职责时不存在虚假记载、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基金，但不保证基金一定盈利。

基金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。

本报告期自2015年7月1日起至9月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	工银增强收益债券
交易代码	489106
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年07月04日
报告期末基金份额总额	2,162,806,266.06份

在控制风险与保持资产流动性的基础上，力争基金资产实现稳步、低风险、稳定的收益。

在确保基金资产安全的前提下，通过定期调整类产品的投资比例来获得稳定的收益，同时适当参与新股发行申购、增发新股和新上市股票的投资品种，为基金持有人增加收益。

本基金的业绩比较基准为一年期定期存款利率(税后) + 1.2%。

基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司

中国建信(信托)有限责任公司

下属分级基金的基金简称

工银增强收益债券A 工银增强收益债券B

下属分级基金的交易代码

489106 489006

下属分级基金的最新交易代码

489106 489006

报告期末下级分级基金的份额总额

1,346,981,096.76份 815,824,168.91份

§ 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7月1日 - 2015年9月30日)

工银增强收益债券 A 工银增强收益债券B

1.本期已实现收益 -26,085,500.25 -14,200,829.03

2.本期利润 -9,541,228.73 -8,156,401.59

3.加权平均基金份额本期利润 0.0703 -0.0116

4.期末基金资产净值 1,722,417,517.96 1,039,891,093.42

5.期末基金份额净值 1,2297 -1.2747

(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不计费用的净值。

(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。

(3)“本期利润”为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

(4)“加权平均基金份额本期利润”是指计算基金份额平均数时取值保留到小数点后三位。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

图例:工银增强收益债券A 工银增强收益债券B

阶段 净值增长率为% 净值增长率为% 业绩比较基准收益率为% 业绩比较基准收益率为%

过去三个月 -0.94% 0.31% 2.11% 0.06% -2.2% 0.2%

阶段 净值增长率为% 净值增长率为% 业绩比较基准收益率为% 业绩比较基准收益率为%

过去三个月 -0.94% 0.31% 2.11% 0.06% -2.2% 0.2%

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

图例:工银增强收益债券A 工银增强收益债券B

阶段 净值增长率为% 净值增长率为% 业绩比较基准收益率为% 业绩比较基准收益率为%

过去三年 -0.94% 0.31% 2.11% 0.06% -2.2% 0.2%

3.2.3 基金管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本公司严格按照《证券投资基金法》等有关法律法规、基金合同、招募说明书的规定,勤勉尽责地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取最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。

3.2.4 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本公司严格按照《证券投资基金法》等有关法律法规、基金合同、招募说明书的规定,勤勉尽责地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取最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。

3.2.5 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本公司严格按照《证券投资基金法》等有关法律法规、基金合同、招募说明书的规定,勤勉尽责地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取最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。

3.2.6 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本公司严格按照《证券投资基金法》等有关法律法规、基金合同、招募说明书的规定,勤勉尽责地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取最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。

3.2.7 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本公司严格按照《证券投资基金法》等有关法律法规、基金合同、招募说明书的规定,勤勉尽责地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取最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。

3.2.8 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本公司严格按照《证券投资基金法》等有关法律法规、基金合同、招募说明书的规定,勤勉尽责地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取最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。

3.2.9 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本公司严格按照《证券投资基金法》等有关法律法规、基金合同、招募说明书的规定,勤勉尽责地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取最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。

3.2.10 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本公司严格按照《证券投资基金法》等有关法律法规、基金合同、招募说明书的规定,勤勉尽责地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取最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。

3.2.11 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本公司严格按照《证券投资基金法》等有关法律法规、基金合同、招募说明书的规定,勤勉尽责地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取最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。

3.2.12 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本公司严格按照《证券投资基金法》等有关法律法规、基金合同、招募说明书的规定,勤勉尽责地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取最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。

3.2.13 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本公司严格按照《证券投资基金法》等有关法律法规、基金合同、招募说明书的规定,勤勉尽责地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取最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。

3.2.14 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本公司严格按照《证券投资基金法》等有关法律法规、基金合同、招募说明书的规定,勤勉尽责地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取最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。

3.2.15 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本公司严格按照《证券投资基金法》等有关法律法规、基金合同、招募说明书的规定,勤勉尽责地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取最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。

3.2.16 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本公司严格按照《证券投资基金法》等有关法律法规、基金合同、招募说明书的规定,勤勉尽责地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取最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。

3.2.17 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本公司严格按照《证券投资基金法》等有关法律法规、基金合同、招募说明书的规定,勤勉尽责地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取最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。

3.2.18 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本公司严格按照《证券投资基金法》等有关法律法规、基金合同、招募说明书的规定,勤勉尽责地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取最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。

3.2.19 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本公司严格按照《证券投资基金法》等有关法律法规、基金合同、招募说明书的规定,勤勉尽责地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取最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。

3.2.20 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本公司严格按照《证券投资基金法》等有关法律法规、基金合同、招募说明书的规定,勤勉尽责地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取最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。

3.2.21 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本公司严格按照《证券投资基金法》等有关法律法规、基金合同、招募说明书的规定,勤勉尽责地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取最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。

3.2.22 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本公司严格按照《证券投资基金法》等有关法律法规、基金合同、招募说明书的规定,勤勉尽责地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取最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。

3.2.23 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本公司严格按照《证券投资基金法》等有关法律法规、基金合同、招募说明书的规定,勤勉尽责地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取最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。

3.2.24 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本公司严格按照《证券投资基金法》等有关法律法规、基金合同、招募说明书的规定,勤勉尽责地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取最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。

3.2.25 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本公司严格按照《证券投资基金法》等有关法律法规、基金合同、招募说明书的规定,勤勉尽责地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取最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。

3.2.26 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本公司严格按照《证券投资基金法》等有关法律法规、基金合同、招募说明书的规定,勤勉尽责地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取最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。

3.2.27 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本公司严格按照《证券投资基金法》等有关法律法规、基金合同、招募说明书的规定,勤勉尽责地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取最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。

3.2.28 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本公司严格按照《证券投资基金法》等有关法律法规、基金合同、招募说明书的规定,勤勉尽责地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取最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。

3.2.29 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本公司严格按照《证券投资基金法》等有关法律法规、基金合同、招募说明书的规定,勤勉尽责地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取最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。

3.2.30 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本公司严格按照《证券投资基金法》等有关法律法规、基金合同、招募说明书的规定,勤勉尽责地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取最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。

3.2.31 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本公司严格按照《证券投资基金法》等有关法律法规、基金合同、招募说明书的规定,勤勉尽责地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取最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。

3.2.32 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本公司严格按照《证券投资基金法》等有关法律法规、基金合同、招募说明书的规定,勤勉尽责地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取最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。

3.2.33 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本公司严格按照《证券投资基金法》等有关法律法规、基金合同、招募说明书的规定,勤勉尽责地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取最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。

3.2.34 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本公司严格按照《证券投资基金法》等有关法律法规、基金合同、招募说明书的规定,勤勉尽责地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取最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。

3.2.35 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本公司严格按照《证券投资基金法》等有关法律法规、基金合同、招募说明书的规定,勤勉尽责地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取最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。

3.2.36 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本公司严格按照《证券投资基金法》等有关法律法规、基金合同、招募说明书的规定,勤勉尽责地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取最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。

3.2.37 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本公司严格按照《证券投资基金法》等有关法律法规、基金合同、招募说明书的规定,勤