

## 工银瑞信添福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：中国民生银行股份有限公司  
报告送出日期：2015年10月30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、完整性、及时性承担个别及连带责任。

基金托管人及国泰君安证券股份有限公司根据本基金合同的规定，于2015年10月22日核对了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

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当仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2015年7月1日起至2015年9月30日止。

§ 2 基本产品概况

基金简称 工银添福债券

交易代码 000014

运作方式 约定期开放式

合同生效日 2013年10月31日

报告期末基金份额总额 1,817,506,651.40份

投资目标 在保持基金资产流动性与控制基金风险的前提下，力争实现超越行业平均水平的长期回报为目标，为投资者提供稳定的投资回报。

投资策略 本基金将定期评估股票、信用债券、货币市场工具等不同投资品种的预期收益和风险，在严格控制风险的前提下，发掘和利用市场失常状态下的投资机会，以实现组合的超额收益。

业绩比较基准 人民币计价的三年期银行定期存款利率（税后）+50%

风险收益特征 本基金属债券型基金，风险与预期收益低于货币市场基金，高于股票型基金。

基金管理人 工银瑞信基金管理有限公司

基金托管人 中国民生银行股份有限公司

下属分级基金的基金简称 工银添福债券A

下属分级基金的交易代码 000014

报告期末下属分级基金的份额总额 1,548,750,621.37份

报告期末下属分级基金的份额总额 268,845,030.12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)

工银添福债券A 工银添福债券B

1. 本期总回报 收益-30,291,764.19 -8,000,161.30

2. 本期利润 -6,090,020.91 -4,178,402.30

3. 加权平均基金份额本期利润率 -0.0079% -0.0100%

4. 期末基金份额净值 2,463,287,186.61 422,628,200.32

5. 期末可供分配基金份额利润 1,900 1,572

注：1. 上述基金业业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计算费用影响实际收益水平要低于所列数字。

2. 本期利润为收入减去必要的费用后的余额，其中收入不包含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额；

3. 所示数据截至2015年9月30日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本期总回报率及相对收益的比较

阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

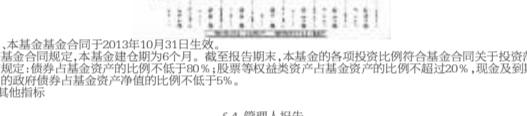
过去三个月 -0.31% 0.27% -1.30% -1.70% 0.26%

阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -0.51% 0.27% -0.01% -1.90% 0.26%

3.2.2 日基金额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

3.2.3 月度走势图



注：1. 本基金基金合同于2013年10月31日生效。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约定；本基金基金合同的6个月期限尚未届满，因此未计算基金成立以来的基金资产净值增长率。

2. 按基金合同规定，本基金基金合同期为6个月。截至报告期末，本基金的各项投资比例不超过20%，现金及到期日在一年内的投资比例占基金资产的比例不低于90%；股票等权益类资产占基金资产的比例不超过10%，现金及到期日在一年内的投资比例占基金资产净值的比例不高于5%。

3. 其他指标

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间 证券从业年限 说明

杜海涛 基金总账 及固定收益部总监 - 18 先后在宝盈基金管理有限公司担任基金经理助理、基金经理，2006年加入工银瑞信，现任基金投资部固定收益总监兼基金经理，2013年10月31日至今，担任工银添福债券型证券投资基金基金经理，2014年1月11日至2014年10月10日，担任工银添福债券型证券投资基金基金经理，2014年10月11日至2015年9月30日，担任工银添福债券型证券投资基金基金经理，2015年10月11日至2016年4月17日，担任工银添福债券型证券投资基金基金经理，2016年4月18日至2016年7月1日，担任工银添福债券型证券投资基金基金经理，2016年7月2日至2016年9月30日，担任工银添福债券型证券投资基金基金经理。

杜海涛 2013年10月31日 - 18

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规情况的说明

基金管理人严格按照《证券投资基金法》等有关法律法规、基金合同的规定，履行诚实守信、勤勉尽责的义务，避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为。

4.3 小额定期定额申购赎回的情况

本基金在报告期内未进行小额定期定额申购赎回操作。

4.4 报告期内基金的买卖情况

本基金在报告期内未进行基金的买卖操作。

4.5 报告期内基金的分红情况

本基金在报告期内未进行基金的分红操作。

4.6 报告期内基金的费用情况

本基金在报告期内未发生费用。

4.7 基金管理人对本基金的估值政策

本基金在报告期内未发生对本基金的估值政策的调整。

4.8 其他费用

本基金在报告期内未发生其他费用。

4.9 其他

本基金在报告期内未发生其他事项。

5. 投资组合分析

5.1 期末基金资产配置

本基金在报告期内未发生对本基金资产配置的调整。

5.2 期末基金资产构成

本基金在报告期内未发生对本基金资产构成的调整。

5.3 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)

1.本期总回报 收益-46,933,157.26

2.本期利润 -1,744,505,321.29

3.加权平均基金份额本期利润 -0.1066%

4.期末基金份额净值 2,503,507,002.60

5.期末基金资产净值 1,6386

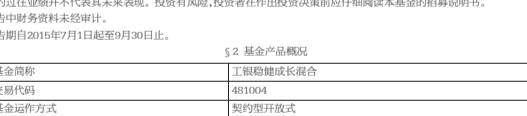
注：1.本期基金业业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计算费用影响实际收益水平要低于所列数字。

2.本期利润为收入减去必要的费用后的余额，其中收入不包含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额；

3.所示数据截至2015年9月30日。

3.2 日基金额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

3.2.1 月度走势图



注：1. 本基金于2013年10月31日生效。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约定；本基金基金合同的6个月期限尚未届满，因此未计算基金成立以来的基金资产净值增长率。

2. 按基金合同规定，本基金基金合同期为6个月。截至报告期末，本基金的各项投资比例不超过20%，现金及到期日在一年内的投资比例占基金资产的比例不低于90%；股票等权益类资产占基金资产的比例不超过10%，现金及到期日在一年内的投资比例占基金资产净值的比例不高于5%。

3. 其他指标

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间 证券从业年限 说明

杨树 权益投资总监 - 13,416,987.76

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规情况的说明

基金管理人严格按照《证券投资基金法》等有关法律法规、基金合同的规定，履行诚实守信、勤勉尽责的义务，避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为。

4.3 小额定期定额申购赎回的情况

本基金在报告期内未进行小额定期定额申购赎回操作。

4.4 报告期内基金的买卖情况

本基金在报告期内未进行基金的买卖操作。

4.5 报告期内基金的分红情况

本基金在报告期内未进行基金的分红操作。

4.6 报告期内基金的费用情况

本基金在报告期内未发生费用。

4.7 基金管理人对本基金的估值政策

本基金在报告期内未发生对本基金的估值政策的调整。

4.8 其他费用

本基金在报告期内未发生其他费用。

4.9 其他

本基金在报告期内未发生其他事项。

5. 投资组合分析

5.1 期末基金资产配置

本基金在报告期内未发生对本基金资产配置的调整。

5.2 期末基金资产构成

本基金在报告期内未发生对本基金资产构成的调整。

5.3 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)

1.本期总回报 收益-56,933,157.26

2.本期利润 -1,744,505,321.29

3.加权平均基金份额本期利润 -0.1066%

4.期末基金份额净值 2,503,507,002.60

5.期末基金资产净值 1,6386

注：1.本期基金业业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计算费用影响实际收益水平要低于所列数字。

2.本期利润为收入减去必要的费用后的余额，其中收入不包含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额；

3.所示数据截至2015年9月30日。

3.2 日基金额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

3.2.1 月度走势图



注：1. 本基金于2013年10月31日生效。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约定；本基金基金合同的6个月期限尚未届满，因此未计算基金成立以来的基金资产净值增长率。

2. 按基金合同规定，本基金基金合同期为6个月。截至报告期末，本基金的各项投资比例不超过20%，现金及到期日在一年内的投资比例占基金资产的比例不低于90%；股票等权益类资产占基金资产的比例不超过10%，现金及到期日在一年内的投资比例占基金资产净值的比例不高于5%。

3. 其他指标

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间 证券从业年限 说明

杨树 权益投资总监 - 13,416,987.76

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规情况的说明

</div