工银瑞信泰享三年理财债券型证券投资基金

【2017】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:宁波银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一七年四月二十二日

§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。

基金托管人宁波银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年4月20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。

本报告期自2017年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	工银泰享三年理财债券
交易代码	002750
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年5月5日
报告期末基金份额总额	30,000,354,756.96份
投资目标	本基金采取严格的买入持有到期投资策略,投资于剩余期限(或回售期限)不超过基金剩余封闭期的固定收益类工具,力求基金资产的稳健增值。
投资策略	本基金以封闭期为周期进行投资运作。在封闭期内,本基金采用买入并持有策略构建投资组合,对所投资固定收益品种的剩余期限与基金的剩余封闭期进行期限匹配,投资于剩余期限(或回售期限)不超过基金剩余封闭期的固定收益类工具。一般情况下,本基金持有的债券品种和贮构在封闭期内不会发生变化。
业绩比较基准	在每个封闭期,本基金的业绩比较基准为该封闭期起始日的中国人民银行公布并执行的金融机构三年期定期存款利率(税后)。
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于低风险基金产品,其长期平均风险和预期收益率低于股票型及混合型基金,高于货币市场基金。
基金管理人	工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人	宁波银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2017年1月1日 - 2017年3月31日)
1.本期已实现收益	172,839,694.75
2.本期利润	172,839,694.75
3.加权平均基金份额本期利润	0.0058
4.期末基金资产净值	30,008,178,673.90
5.期末基金份额净值	1.000

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所列数字。

2、本期已实现收益是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公允价值变动收益。

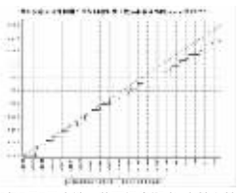
3、所列数据截止到报告期最后一日,无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.56%	0.03%	0.68%	0.01%	-0.12%	0.02%

3.2.2 自基金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



注:1、本基金基金合同于2016年5月5日生效。截至报告期末,本基金基金合同生效不满一年。

2、按基金合同规定,基金管理人应当自每个封闭期开始之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。建仓期满,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规定:本基金对债券的投资比例不低于基金资产的80%。但应开放期流动性需要,为保护基金份额持有人利益,每个开放期开始前六个月至开放期结束后六个月内不受前述比例限制。

3.3 其他指标

无。

§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限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陆欣	固定收益部副总监,本基金的基金经理	2016年5月6日	-	11	先后在中国银行担任债券交易员,在光大保德信基金管理公司担任固定收益副总监兼基金经理。2014年加入工银瑞信,现任固定收益部副总监。2014年6月18日至今,担任工银纯债债券型基金基金经理;2015年4月17日至今,担任工银瑞信纯债定期开放债券型基金基金经理;2015年11月13日至今,担任工银目标收益一年定期开放债券型基金基金经理;2015年12月2日至今,担任工银中高等级信用债债券型基金基金经理;2016年4月22日至今,担任工银瑞信瑞丰纯债半年定期开放债券型证券投资基金基金经理;2016年5月4日至今,担任工银瑞信泰享三年理财债券型证券投资基金基金经理;2016年5月31日至今,担任工银瑞信恒享纯债债券型证券投资基金基金经理;2016年8月26日至今,担任工银瑞信隆享纯债债券型证券投资基金基金经理;2016年12月16日至今,担任工银瑞信国债纯债债券型证券投资基金基金经理。
陈桂都	本基金的基金经理	2016年9月2日	-	9	2008年加入工银瑞信,曾任中央交易室债券交易员、中央交易室债券交易业务主管、固定收益部研究员、专户投资部投资经理、固定收益部投资经理。2016年9月2日至今,担任工银瑞信恒享纯债债券型证券投资基金基金经理;2016年9月2日至今,担任工银瑞信泰享三年理财债券型证券投资基金的基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定,依照诚实信用、勤勉尽责的原则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求最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

为了公平对待各类投资人,保护各类投资人利益,避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为,公司根据《证券投资基金法》、《基金管理公司特定客户资产管理业务试点办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规和公司内部规章,拟定了《公平交易管理办法》、《异常交易管理办法》,对公司管理的各类资产的公平对待做了明确具体的规定,并规定对买卖股票、债券时候的价格和市场价格差距较大,可能存在操纵股价、利益输送等违法违规情况进行监控。本报告期,按照时间优先、价格优先的原则,本公司对满足限价条件且对同一证券有相同交易需求的基金等投资组合,均采用了系统中的公平交易模块进行操作,实现了公平交易;未出现异常不利位的情况,且本基金及本基金与本基金管理人管理的其他投资组合之间未发生法律法规禁止的反向交易及交叉交易。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内未出现异常交易的情况。本报告期内,本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的5%。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

国内方面,1季度我国经济走势平稳,工业企业利润恢复,房地产开发投资进一步上行;CPI由于食品价格的下跌出现回落,但是PPI延续上涨势头,PPI和CPI的缺口进一步拉大。在经济走势平稳的情况下,央行继续实行稳健偏中性的货币政策,保持金融系统的流动性合理稳定,但季末时点流动性阶段性有所收紧,回购利率中枢上行。世界经济出现一些积极迹象,但不同国家表现有一定分化。美国就业及消费继续改善,美联储在3月份再次加息;欧元区PMI进一步回升,但英国正式启动脱欧程序为欧元区带来更多不确定性;日本经济依然面临着通缩压力。

1季度债券市场继续调整,10年国债收益率从4季度末3.01%附近最高上行到3.49%附近后有所回落,在振荡中运行。同期限金融债收益率波动幅度更大一些;信用债券收益率也有较大幅度上行。

本基金在报告期内根据宏观经济和通胀形势的变化,在基金封闭期内保持组合杠杆水平和组合静态收益水平。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内,本基金净值增长率为0.56%,业绩比较基准收益率为0.68%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金在报告期内没有触及2014年8月8日生效的《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条规定的条件。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	46,184,043,600.17	97.10
	其中:债券	46,184,043,600.17	97.10
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	692,194,657.85	1.46
8	其他资产	687,428,362.81	1.45
9	合计	47,563,666,620.83	100.00

注:由于四舍五入的原因金额占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票投资。

5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

无。

5.3 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

本基金本报告期末未持有股票投资。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	14,801,244,044.40	49.32
	其中:政策性金融债	14,801,244,044.40	49.32
4	企业债券	8,851,541,903.17	29.50
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	4,360,141,872.17	14.53
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	地方政府债	18,171,115,780.43	60.55
10	其他	-	-
11	合计	46,184,043,600.17	153.90

注:由于四舍五入的原因摊余成本占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	130877	16贵州01	30,000,000	2,980,979,034.59	9.93
2	130856	16辽宁01	22,000,000	2,192,803,632.58	7.31
3	130895	16黑龙01	21,400,000	2,132,478,608.10	7.11
4	110420	11农发20	16,200,000	1,639,237,946.11	5.46
5	122239	13中油01	15,861,000	1,609,958,476.41	5.37

5.6 报告期末按摊余成本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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

本报告期内,本基金未运用国债期货进行投资。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

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 本期国债期货投资评价

本报告期内,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 本基金投资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公开谴责、处罚的情形。

5.10.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	687,428,362.81
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	687,428,362.81

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	30,000,354,756.96
报告期期间基金总申购份额	-
减:报告期期间基金总赎回份额	-
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	30,000,354,756.96

注:1、报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额;

2、报告期期间基金总赎回份额含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金本报告期基金管理人未有运用固有资金投资本基金的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20170101-20170331	30,000,344,000.00	0.00	0.00	30,000,344,000.00	100.00%
产品特有风险							
本基金份额持有人较为集中,存在基金规模大幅波动的风险,以及由此导致基金收益较大波动的风险。							

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金管理人于2017年3月28日发布分红公告,以截至2017年3月22日的可分配收益为基准,按每10份基金份额派发红利0.136元,共计派发红利408,004,825.54元,权益登记日为2017年3月29日。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会准予工银瑞信泰享三年理财债券型证券投资基金募集申请的注册文件;

2、《工银瑞信泰享三年理财债券型证券投资基金基金合同》;

3、《工银瑞信泰享三年理财债券型证券投资基金托管协议》;

4、基金管理人业务资格批件、营业执照;

5、基金托管人业务资格批件、营业执照;

6、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

9.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的住所。

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅。也可在支付工本费后,在合理时间内取得上述文件的复印件。

工银瑞信添福债券型证券投资基金

【2017】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:中国民生银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一七年四月二十二日

§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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年4月20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。

本报告期自2017年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	工银添福债券	
交易代码	000184	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年10月31日	
报告期末基金份额总额	2,785,055,638.13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,力争实现超越业绩比较基准的长期投资回报,为投资者提供养老投资的工具。	
投资策略	本基金的投资风格以稳健为主,在资产配置策略的基础上,通过固定收益类品种投资策略构筑债券组合的平稳收益,通过积极的权益类资产投资策略追求基金资产的增强回报。在债券资产的投资上,主要选择信用风险较低,到期收益率较高的债券进行投资配置;在股票资产的投资上,主要选择基本面良好,股息率较高且具备稳定分红历史的股票进行投资。	
业绩比较基准	人民币税后三年期银行定期存款利率+1.50%。三年期定期存款利率是指每年的第一个工作日中国人民银行网站上发布的三年期"金融机构人民币存款基准利率"。	
风险收益特征	本基金为债券型基金,预期风险与预期收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。	
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	工银添福债券B
下属分级基金的交易代码	000184	000185
报告期末下属分级基金的份额总额	2,733,495,818.51份	51,559,819.62份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2017年1月1日 - 2017年3月31日)	
	工银添福债券A	工银添福债券B
1. 本期已实现收益	-32,232,817.36	-640,847.44
2. 本期利润	-430,880.57	-130,860.03
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0001	-0.0023
4. 期末基金资产净值	4,476,725,335.98	82,992,447.90
5. 期末基金份额净值	1.638	1.610

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所列数字。

2、本期已实现收益是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公允价值变动收益。

3、所列数据截止到报告期最后一日,无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

工银添福债券A

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.00%	0.19%	1.05%	0.01%	-1.05%	0.18%

工银添福债券B

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.06%	0.19%	1.05%	0.01%	-1.11%	0.18%

3.2.2 自基金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

注:1、本基金基金合同于2013年10月31日生效。

2、按基金合同规定,本基金建仓期为6个月。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规定:债券占基金资产的比例不低于80%;股票等权益类资产占基金资产的比例不超过20%,现金及到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于5%。

3.3 其他指标

无。

§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限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杜海涛	副总经理,本基金的基金经理。	2013年10月31日	-	20	先后在宝盈基金管理有限公司担任基金经理助理、招商基金管理有限公司担任招商现金增值基金基金经理;2006年加入工银瑞信,现任副总经理,兼任工银瑞信资产管理(国际)有限公司董事;2006年9月21日至2011年4月21日,担任工银货币市场基金基金经理;2010年8月16日至2012年1月10日,担任工银双利债券型基金基金经理;2007年5月11日至今,担任工银瑞信添财债券型基金基金经理;2011年8月10日至今,担任工银瑞信添福债券型证券投资基金基金经理;2012年6月21日至今,担任工银纯债定期开放债券基金经理;2012年7月7日至今,担任工银货币市场基金基金经理;2013年8月14日至2015年11月11日,担任工银月月新定期支付债券型基金基金经理;2013年10月31日至今,担任工银瑞信添福债券基金基金经理;2014年1月27日至今,担任工银新金货币市场基金基金经理;2015年4月17日至今,担任工银总回报灵活配置混合型基金基金经理。
宋炳坤	权益投资总监兼研究总监,本基金的基金经理	2012年2月14日	-	13	曾任中信建投证券有限公司研究员;2007年加入工银瑞信,现任权益投资总监兼研究部总监。2012年2月14日至今,担任工银瑞信添福债券型证券投资基金基金经理;2013年1月18日至今,担任工银双利债券基金基金经理;2013年1月7日至今,担任工银双利债券型基金基金经理;2013年10月31日至今,担任工银瑞信添福债券基金基金经理;2014年12月9日至今,担任工银瑞信60天期限债券型基金基金经理;2014年1月20日至今,担任工银瑞信红利混合型证券投资基金基金经理;2014年1月20日至今,担任工银瑞信核心价值混合型证券投资基金基金经理;2014年10月23日至今,担任工银瑞信研究精选股票型基金基金经理;2014年11月18日至今,担任工银医疗保健行业股票型基金基金经理;2015年2月16日至今,担任工银瑞信轮动主题股票基金基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定,依照诚实信用、勤勉尽责的原则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求最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

为了公平对待各类投资人,保护各类投资人利益,避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为,公司根据《证券投资基金法》、《基金管理公司特定客户资产管理业务试点办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规和公司内部规章,拟定了《公平交易管理办法》、《异常交易管理办法》,对公司管理的各类资产的公平对待做了明确具体的规定,并规定对买卖股票、债券时候的价格和市场价格差距较大,可能存在操纵股价、利益输送等违法违规情况进行监控。本报告期,按照时间优先、价格优先的原则,本公司对满足限价条件且对同一证券有相同交易需求的基金等投资组合,均采用了系统中的公平交易模块进行操作,实现了公平交易;未出现异常不利位的情况,且本基金及本基金与本基金管理人管理的其他投资组合之间未发生法律法规禁止的反向交易及交叉交易。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内未出现异常交易的情况。本报告期内,本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的5%。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

一季度,全球经济延续了2016年四季度以来的回升态势,各项指标持续向好,基本面韧性明显增强,这为全球央行货币政策调整提供了基础和空间:美联储3月加息并对外释放下半年缩表的信号,中国人民银行也两度上调公开市场操作利率。与此同时,特朗普医改方案在美国众议院受阻使得市场对其财政刺激政策的力度产生怀疑,国内大宗商品价格在一季度也呈现高位钝化态势,2016年四季度以来的全球"再通胀交易"呈现出阶段性回潮的特征。

债券方面,由于2016年四季度遭受了过度的抛售,当前利率水平对现有利空已有较充分的反应,因此即便一季度经济数据和货币政策都偏利空,债券收益率也只是小幅震荡上行,并未如2016年四季度一样呈现出明显趋势,但流动性收缩的背景下,信用利差小幅走阔。股票方面,经济预期好转带动指数震荡上行,但结构分化明显。转债方面,受制于股债资产走势相背离,整体方向不明显。

报告期内本基金根据宏观经济和通胀形势的变化,小幅提升杠杆,保持较短久期,保持较高权益仓位,提升转债仓位,继续积极减持低评级债券。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内,工银添福债券A份额净值增长率为0.00%,工银添福债券B份额净值增长率为-0.06%,业绩比较基准收益率为1.05%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金在报告期内没有触及2014年8月8日生效的《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条规定的条件。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	764,352,097.94	14.26
	其中:股票	764,352,097.94	14.26
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	4,144,434,304.29	77.30
	其中:债券	4,144,434,304.29	77.30
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	349,600,644.40	6.52
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	34,019,470.01	0.63
8	其他资产	68,771,343.56	1.28
9	合计	5,361,177,860.20	100.00

注:由于四舍五入的原因金额占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	334,816,756.60	7.34
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	25,492,948.81	0.56
F	批发和零售业	25,611,618.60	0.56
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	216,268,596.61	4.74
K	房地产业	133,902,177.32	2.94
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	28,260,000.00	0.62
S	综合	-	-
	合计	764,352,097.94	16.76

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。

5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

无。

5.3 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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300285	国瓷材料	3,523,852	141,059,795.56	3.09
2	002142	宁波银行	6,799,912	125,254,379.04	2.75
3	300429	强力新材	3,760,344	112,998,337.20	2.48
4	000567	海德股份	2,529,900	77,364,342.00	1.70
5	600643	爱建集团	4,906,663	65,700,217.57	1.44
6	002531	天顺风能	4,499,812	32,938,623.84	0.72
7	601179	中国西电	5,000,000	31,850,000.00	0.70
8	600266	北京城建	1,999,908	29,278,653.12	0.64
9	002739	万达院线	500,000	28,260,000.00	0.62
10	600340	华夏幸福	999,970	27,259,182.20	0.60

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	299,466,000.00	6.57
2	央行票据	-	-
3	金融债券	39,416,000.00	0.86
	其中:政策性金融债	39,416,000.00	0.86
4	企业债券	526,337,534.81	11.54
5	企业短期融资券	958,989,000.00	21.03
6	中期票据	1,839,488,000.00	40.34
7	可转债(可交换债)	480,737,769.48	10.54
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	4,144,434,304.29	90.89

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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	019539	16国债11	2,100,000	209,874,000.00	4.60
2	101654080	16船重MTN001	2,000,000	195,120,000.00	4.28
3	011698717	16华能SCP002	1,800,000	179,712,000.00	3.94
4	110032	三一转债	1,000,000	111,060,000.00	2.44
5	132004	15国盛EB	1,100,000	106,546,000.00	2.34

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

本报告期内,本基金未运用国债期货进行投资。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

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 本期国债期货投资评价

本报告期内,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 本基金投资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公开谴责、处罚的情形。

5.10.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	501,422.24
2	应收证券清算款	8,991,819.08
3	应收股利	-
4	应收利息	59,254,408.09
5	应收申购款	23,594.15
6	其他应收款	100.00
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	68,771,343.56

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110032	三一转债	111,060,000.00	2.44
2	132004	15国盛EB	106,546,000.00	2.34
3	132005	15国资EB	74,046,000.00	1.62
4	113008	电气转债	34,329,000.00	0.75
5	123001	蓝标转债	21,878,619.54	0.48
6	128012	辉丰转债	17,364,180.08	0.38
7	110033	国贸转债	11,491,000.00	0.25
8	128013	洪涛转债	10,434,248.76	0.23
9	132002	15天集EB	7,703,176.80	0.17
10	113009	广汽转债	4,844,000.00	0.11
11	113010	江南转债	3,144,265.60	0.07
12	110035	白云转债	1,623,689.20	0.04
13	132003	15浦EB	799,469.50	0.02

注:上表包含期末持有的处于转股期的可转换债券和可交换债券明细。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	工银添福债券A	工银添福债券B
报告期期初基金份额总额	3,692,244,830.47	61,388,677.87
报告期期间基金总申购份额	5,203,813.90	1,117,294.92
减:报告期期间基金总赎回份额	963,952,825.86	10,946,153.17
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	2,733,495,818.51	51,559,819.62

注:1、报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额;

2、报告期期间基金总赎回份额含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	13,416,987.76
报告期期间买入/申购总份额	0.00
报告期期间卖出/赎回总份额	0.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	13,416,987.76
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.48

注:报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额;

报告期期间基金总赎回份额含转换出份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投本基金交易明细

本基金本报告期基金管理人未有运用固有资金投本基金的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20170101-20170331	1,937,294,812.18	0.00	931,527,008.92	1,005,767,803.26	36.11%
	2	20170101-20170331	926,015,353.27	0.00	0.00	926,015,353.27	33.25%
产品特有风险							
本基金份额持有人较为集中,存在基金规模大幅波动的风险,以及由此导致基金收益较大波动的风险。							

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准工银瑞信添福债券型证券投资基金设立的文件;

2、《工银瑞信添福债券型证券投资基金基金合同》;

3、《工银瑞信添福债券型证券投资基金托管协议》;

4、基金管理人业务资格批件和营业执照;

5、基金托管人业务资格批件和营业执照;

6