

工银瑞信纯债定期开放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:交通银行股份有限公司
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、完整性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人交通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数据、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 基本产品概况

基金简称	工银瑞信定期开放债券
基金代码	200006
基金运作方式	定期开放式
上市交易代码	166418
基金合同生效日	2012年6月1日
基金管理人	工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司

§ 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.本期利润	-4,431,008.20
2.本期利润	-1,209,000.00
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0328
4.期末基金资产净值	200,000,000.00
5.期末基金份额净值	1.000

注:1.上证基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计算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,无节假日为开放日或交易日的交易日。

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	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差
过去三个月	-0.025%	0.00%	0.00%	0.00%
过去一年	-1.01%	0.00%	0.00%	0.00%
过去三年	-0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
自基金合同生效以来	73.79%	0.02%	100.00%	0.00%

注:由于四舍五入的原因基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

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.本基金合同于2012年6月21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、投资禁止行为及限制的规定:债券等固定收益类资产占基金资产的比例不低于80%,但开放式基金的余额,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,无节假日为开放日或交易日的交易日。

3.2.3 基金净值表现

3.2.3.1 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	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差
过去三个月	-0.025%	0.00%	0.00%	0.00%
过去一年	-1.01%	0.00%	0.00%	0.00%
过去三年	-0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
自基金合同生效以来	73.79%	0.02%	100.00%	0.00%

注:由于四舍五入的原因基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

3.2.4 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明细

3.2.4.1 基金投资组合的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

3.2.4.2 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	银行存款	8,544,600
2	应收利息	-
3	应收股利	-
4	应收利润	31,101,800.20
5	应付申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,643,400.20

注:1.上证基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计算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,无节假日为开放日或交易日的交易日。

3.4 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年限	证券从业年限	说明
杜海涛	基金经理,本基金基金经理	2016年4月21日	-	20
孙晓	基金经理,本基金基金经理	2016年4月17日	-	11

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金报告期内,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。

4.3 公平交易制度的执行情况

为了公平对各类投资人,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》、《证券投资基金托管人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《公平交易管理制度》、《异常交易管理办法》,对公司管理的各类资产的公平对待做出了规定,并规定对买卖股票、债券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实行监控。本报告期内,按照公平对待、价格优先的原则对买卖证券条件相同且有相同交易需求的基金等投资组合,均采用了系统的公平交易模块进行操作,实现了公平交易,未出现计算不到的情况,且本基金及基金管理人对基金投资组合的其他投资组合未发生不公平交易的情况。

4.4 异常交易行为的专项说明

本基金报告期内未出现异常交易的情况。报告期内,本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价交易日均未出现异常交易的情况。

4.4.1 报告期内本基金投资组合运作情况

4.4.2 报告期内本基金投资组合运作公平性分析

4.4.3 报告期内本基金投资组合未发生内幕交易、操纵市场等违法违规行为。

4.4.4 报告期内本基金投资组合未发生不公平交易和利益输送行为。

4.4.5 报告期内本基金投资组合未发生重大关联交易。

4.4.6 报告期内本基金投资组合未发生涉及本公司的重大诉讼事项。

4.4.7 报告期内本基金投资组合未发生支付大额赎回的情况。

4.4.8 报告期内本基金投资组合未发生涉及本公司的重大仲裁事项。

4.4.9 报告期内本基金投资组合未发生涉及本公司的重大行政处罚事项。

4.4.10 报告期内本基金投资组合未发生涉及本公司的重大民事诉讼事项。

4.4.11 报告期内本基金投资组合未发生涉及本公司的重大行政诉讼事项。

4.4.12 报告期内本基金投资组合未发生涉及本公司的重大仲裁事项。

4.4.13 报告期内本基金投资组合未发生涉及本公司的重大行政处罚事项。

4.4.14 报告期内本基金投资组合未发生涉及本公司的重大民事诉讼事项。

4.4.15 报告期内本基金投资组合未发生涉及本公司的重大行政诉讼事项。

4.4.16 报告期内本基金投资组合未发生涉及本公司的重大仲裁事项。

4.4.17 报告期内本基金投资组合未发生涉及本公司的重大行政处罚事项。

4.4.18 报告期内本基金投资组合未发生涉及本公司的重大民事诉讼事项。

4.4.19 报告期内本基金投资组合未发生涉及本公司的重大行政诉讼事项。

4.4.20 报告期内本基金投资组合未发生涉及本公司的重大仲裁事项。

4.4.21 报告期内本基金投资组合未发生涉及本公司的重大行政处罚事项。

4.4.22 报告期内本基金投资组合未发生涉及本公司的重大民事诉讼事项。

4.4.23 报告期内本基金投资组合未发生涉及本公司的重大行政诉讼事项。

4.4.24 报告期内本基金投资组合未发生涉及本公司的重大仲裁事项。

4.4.25 报告期内本基金投资组合未发生涉及本公司的重大行政处罚事项。

4.4.26 报告期内本基金投资组合未发生涉及本公司的重大民事诉讼事项。

4.4.27 报告期内本基金投资组合未发生涉及本公司的重大行政诉讼事项。

4.4.28 报告期内本基金投资组合未发生涉及本公司的重大仲裁事项。

4.4.29 报告期内本基金投资组合未发生涉及本公司的重大行政处罚事项。

4.4.30 报告期内本基金投资组合未发生涉及本公司的重大民事诉讼事项。

4.4.31 报告期内本基金投资组合未发生涉及本公司的重大行政诉讼事项。

4.4.32 报告期内本基金投资组合未发生涉及本公司的重大仲裁事项。

4.4.33 报告期内本基金投资组合未发生涉及本公司的重大行政处罚事项。

4.4.34 报告期内本基金投资组合未发生涉及本公司的重大民事诉讼事项。

4.4.35 报告期内本基金投资组合未发生涉及本公司的重大行政诉讼事项。

4.4.36 报告期内本基金投资组合未发生涉及本公司的重大仲裁事项。

4.4.37 报告期内本基金投资组合未发生涉及本公司的重大行政处罚事项。

4.4.38 报告期内本基金投资组合未发生涉及本公司的重大民事诉讼事项。

4.4.39 报告期内本基金投资组合未发生涉及本公司的重大行政诉讼事项。

4.4.40 报告期内本基金投资组合未发生涉及本公司的重大仲裁事项。

4.4.41 报告期内本基金投资组合未发生涉及本公司的重大行政处罚事项。

4.4.42 报告期内本基金投资组合未发生涉及本公司的重大民事诉讼事项。

4.4.43 报告期内本基金投资组合未