

工银瑞信纯债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:兴业银行股份有限公司

报告送出日期:二〇一七年四月二十二日

5.1 重要提示

基金管理人的董事会及监事会在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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同的规定，于二〇一七年四月二十日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配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。

本基金报告中财务数据未经审计。

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

505B

工银瑞信纯债基金本报告期内根据宏观经济和通胀形势的变化，采取中长期操作策略，未来将波段操作债券，争取获得较好收益。

报告期内，工银纯债债券A份额净值增长率为-1.04%，工银纯债债券B份额净值增长率为-1.09%，业绩基准收益率为-0.34%。

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管理暂行办法》第四十一条规定的条件。

5.1 投资组合报告

5.1.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产的比例(%)
1	权证投资	-	-
2	中小企业板股票	-	-
3	创业板股票	-	-
4	债券投资	10,794,177,760.18	95.95%
5	衍生品投资	-	-
6	股票投资	-	-
7	其他投资	-	-
8	银行存款	2,286,411,362.06	1.98%
9	应收利息	1,000,000.00	0.09%
10	应收申购款	999,999.99	0.01%
11	其他资产	0.00	0.00%
12	负债总计	10,794,177,760.18	100.00%
13	报告期末基金资产净值	10,794,177,760.18	100.00%
14	基金份额净值	1.000	1.00%
15	货币市场基金余额	10,794,177,760.18	100.00%
16	应收基金	0.00	0.00%
17	报告期末可供分配基金份额总额	100,000,000.00	1.00%
18	期末可供分配基金份额净值	1.000	1.00%
19	期末可供分配金额	100,000,000.00	1.00%
20	货币市场基金余额	100,000,000.00	100.00%
21	报告期末可供分配金额	100,000,000.00	100.00%
22	报告期末可供分配基金份额总额	100,000,000.00	100.00%
23	报告期末可供分配基金份额净值	1.000	1.00%

注:由于四舍五入的原因基金占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

本基金本报告期尚未持有股票投资。

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期尚未持有股票投资。

5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通股票投资组合

本基金本报告期尚未持有股票投资。

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

本基金本报告期尚未持有股票投资。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期尚未持有债券投资。

5.4.1 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

本基金本报告期尚未持有债券投资。

5.4.2 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

本基金本报告期尚未持有贵金属投资。

5.4.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期尚未持有权证投资。

5.4.4 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股指期货投资明细

本基金本报告期尚未持有股指期货投资。

5.4.5 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国债期货投资明细

本基金本报告期尚未持有国债期货投资。

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十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期尚未持有资产支持证券。

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五名贵金属投资明细

本基金本报告期尚未持有贵金属投资。

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权证投资明细

本基金本报告期尚未持有权证投资。

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股指期货投资明细

本基金本报告期尚未持有股指期货投资。

5.9 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国债期货投资明细

本基金本报告期尚未持有国债期货投资。

5.10 本期国债期货投资情况

本基金本报告期尚未持有国债期货投资。

5.11 本期信用债投资情况

本基金本报告期尚未持有信用债投资。

5.12 本期债券投资情况

本基金本报告期尚未持有债券投资。

5.13 本期资产支持证券投资情况

本基金本报告期尚未持有资产支持证券投资。

5.14 本期股指期货投资情况

本基金本报告期尚未持有股指期货投资。

5.15 本期国债期货投资情况

本基金本报告期尚未持有国债期货投资。

5.16 本期信用债投资情况

本基金本报告期尚未持有信用债投资。

5.17 本期资产支持证券投资情况

本基金本报告期尚未持有资产支持证券投资。

5.18 本期股指期货投资情况

本基金本报告期尚未持有股指期货投资。

5.19 本期国债期货投资情况

本基金本报告期尚未持有国债期货投资。

5.20 本期信用债投资情况

本基金本报告期尚未持有信用债投资。

5.21 本期资产支持证券投资情况

本基金本报告期尚未持有资产支持证券投资。

5.22 本期股指期货投资情况

本基金本报告期尚未持有股指期货投资。

5.23 本期国债期货投资情况

本基金本报告期尚未持有国债期货投资。

5.24 本期信用债投资情况

本基金本报告期尚未持有信用债投资。

5.25 本期资产支持证券投资情况

本基金本报告期尚未持有资产支持证券投资。

5.26 本期股指期货投资情况

本基金本报告期尚未持有股指期货投资。

5.27 本期国债期货投资情况

本基金本报告期尚未持有国债期货投资。

5.28 本期信用债投资情况

本基金本报告期尚未持有信用债投资。

5.29 本期资产支持证券投资情况

本基金本报告期尚未持有资产支持证券投资。

5.30 本期股指期货投资情况

本基金本报告期尚未持有股指期货投资。

5.31 本期国债期货投资情况

本基金本报告期尚未持有国债期货投资。

5.32 本期信用债投资情况

本基金本报告期尚未持有信用债投资。

5.33 本期资产支持证券投资情况

本基金本报告期尚未持有资产支持证券投资。

5.34 本期股指期货投资情况

本基金本报告期尚未持有股指期货投资。

5.35 本期国债期货投资情况

本基金本报告期尚未持有国债期货投资。

5.36 本期信用债投资情况

本基金本报告期尚未持有信用债投资。

5.37 本期资产支持证券投资情况

本基金本报告期尚未持有资产支持证券投资。

5.38 本期股指期货投资情况

本基金本报告期尚未持有股指期货投资。

5.39 本期国债期货投资情况

本基金本报告期尚未持有国债期货投资。

5.40 本期信用债投资情况

本基金本报告期尚未持有信用债投资。

5.41 本期资产支持证券投资情况

本基金本报告期尚未持有资产支持证券投资。

5.42 本期股指期货投资情况

本基金本报告期尚未持有股指期货投资。

5.43 本期国债期货投资情况

本基金本报告期尚未持有国债期货投资。

5.44 本期信用债投资情况

本基金本报告期尚未持有信用债投资。

5.45 本期资产支持证券投资情况

本基金本报告期尚未持有资产支持证券投资。

5.46 本期股指期货投资情况

本基金本报告期尚未持有股指期货投资。

5.47 本期国债期货投资情况

本基金本报告期尚未持有国债期货投资。

5.48 本期信用债投资情况

本基金本报告期尚未持有信用债投资。

5.49 本期资产支持证券投资情况

本基金本报告期尚未持有资产支持证券投资。

5.50 本期股指期货投资情况

本基金本报告期尚未持有股指期货投资。

5.51 本期国债期货投资情况

本基金本报告期尚未持有国债期货投资。

5.52 本期信用债投资情况

本基金本报告期尚未持有信用债投资。

5.53 本期资产支持证券投资情况

本基金本报告期尚未持有资产支持证券投资。

5.54 本期股指期货投资情况

本基金本报告期尚未持有股指期货投资。

5.55 本期国债期货投资情况

本基金本报告期尚未持有国债期货投资。

5.56 本期信用债投资情况

本基金本报告期尚未持有信用债投资。

5.57 本期资产支持证券投资情况

本基金本报告期尚未持有资产支持证券投资。

5.58 本期股指期货投资情况

本基金本报告期尚未持有股指期货投资。

5.59 本期国债期货投资情况

本基金本报告期尚未持有国债期货投资。

5.60 本期信用债投资情况

本基金本报告期尚未持有信用债投资。

5.61 本期资产支持证券投资情况

本基金本报告期尚未持有资产支持证券投资。

5.