

基金管理人：工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人：招商银行股份有限公司
报告送出日期：二零一八年一月二十日

§ 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。

基金托管人招行银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年1月18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，保证复核结果不存在虚假记载、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。

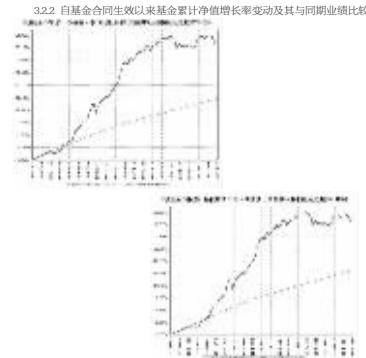
本报告书内容节选自2017年10月1日起至12月31日。

§ 2 基金产品概况

基金简称	工银信用纯债一年定期开放债券
交易代码	000074
基金运作方式	契约型、定期开放式
基金合同生效日	2013年6月22日
报告期末基金份额总额	696,489,762.00份
投资目标	在控制风险并保证资产流动性的基础上，力争实现稳定的当期收益。
投资策略	本基金的主要投资品种为国债、短期融资券、回购协议、票据、证券投资基金、短期和中期的公司债、企业债、可转换债券、资产支持证券等品种，投资于信用等级在AA级（含）以上的固定收益类品种，在严格控制风险的前提下，通过久期调整和资产配置的手段实现组合资产的增值。
业绩比较基准	一年期银行定期存款利率+1.2%。
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于债券基金中较低风险品种，其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金股票型基金。
基金管理人	工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	工银信用纯债一年定期开放债券A
下属分级基金的交易代码	000074
报告期末下属分级基金的份额总额	588,677,572.00份
67,812,179.00份	
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	

工银瑞信信用纯债一年定期开放债券型证券投资基金

2017年第四个季度报告



注:1.本基金管理人于2013年6月22日生效。

2.按基金合同约定,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和投资限制的规定。

3.本基金的业绩比较基准:一年期银行定期存款利率+1.2%。

4.报告期末下属分级基金的份额总额。

5.其他指标

无。

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制度，拟定了《公司交易管理办法》、《异常交易管理办法》，对公司的各项资产的公平对待做了明确具体的规定，并规定对买卖股票、债券的价格和市场价格影响较大，可能存在不公平交易、利益输送或违法违规行为的，公司将按照相关法律法规和公司内部制度的规定进行处理，实行公开公示，由监察稽核部定期对买卖股票、债券的市场价格影响较大的情形进行分析评估，提出相应的处理意见，报公司总经理办公会审议后实施。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金报告期内未出现违反法律法规、行业规范和公司内部制度的情况。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

海外市场方面,发达国家经济复苏态势良好,欧元区表现较为强劲。美国方面,美联储10月初暗示将于12月加息25bp,均符合市场预期,不过会议议息的表态总体偏鸽派,欧洲经济进一步提升,其中欧元区继续下滑,工业品价格也平稳运行,不过外围持续疲弱,叠加避险情绪,使得经济增长出现一定程度的波动性。年内四次降息并暂停操作,使得金价震荡走高,而黄金年末表现则相对较好,金价在供给释放叠加需求的支撑下,金价延续上涨。

国内市场方面,受到流动性及金融监管的影响,债市收益率有所下降,但收益率整体维持低位。债市方面,受到流动性及金融监管的影响,债市收益率有所下降,但收益率整体维持低位。

综上所述,在国内外经济环境的共同作用下,债市收益率整体呈现下行趋势,但收益率整体维持低位。

4.5 管理人对报告期内基金运作遵规守信情况的说明

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,恪守职业道德等有关规定,履行诚实守信、勤勉尽责的职责,不存在损害基金持有人利益的行为。

4.6 管理人对报告期内基金的投资组合报告说明

4.6.1 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	权证投资	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,362,850,618.00	0.263
4	货币市场基金	1,362,850,618.00	0.263
5	债券	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	18,061,443.47	0.24
8	其他资产	71,162,923.68	4.93
9	合计	1,402,464,995.65	100.00

注:由于四舍五入的原因,基金资产总账面价值的分项之和与合计可能有尾差。

4.6.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

4.6.3 报告期末按行业分类的债券投资组合

4.6.4 报告期末按行业分类的资产支持证券投资组合

4.6.5 报告期末按行业分类的贵金属及其它投资组合

4.6.6 报告期末按行业分类的其它资产组合

4.6.7 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

4.6.8 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

4.6.9 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

4.6.10 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

4.6.11 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

4.6.12 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

4.6.13 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

4.6.14 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

4.6.15 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

4.6.16 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

4.6.17 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

4.6.18 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

4.6.19 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

4.6.20 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

4.6.21 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

4.6.22 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

4.6.23 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

4.6.24 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

4.6.25 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

4.6.26 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

4.6.27 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

4.6.28 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

4.6.29 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

4.6.30 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

4.6.31 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

4.6.32 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

4.6.33 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

4.6.34 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

4.6.35 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

4.6.36 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

4.6.37 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

4.6.38 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

4.6.39 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

4.6.40 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

4.6.41 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

4.6.42 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

4.6.43 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

4.6.44 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

4.6.45 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

4.6.46 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

4.6.47 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

4.6.48 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

4.6.49 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

4.6.50 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

4.6.51 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

4.6.52 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

4.6.53 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

4.6.54 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

4.6.55 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

4.6.56 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

4.6.57 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

4.6.58 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

4.6.59 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

4.6.60 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

4.6.61 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

4.6.62 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

4.6.63 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

4.6.64 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

4.6.65 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

4.6.66 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

4.6.67 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

4.6.68 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

4.6.69 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

4.6.70 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

4.6.71 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

4.6.72 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

4.6.73 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

4.6.74 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

4.6.75 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

4.6.76 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

4.6.77 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

4.6.78 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

4.6.79 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

4.6.80 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

4.6.81 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

4.6.82 报