

基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一八年一月二十日

§ 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。
基金托管人:中国农业银行股份有限公司根据本基金合同的规定,于2018年1月18日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。

本报告中财务数据未经审计。

本基金报告期自2017年10月1日起至2017年12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	工银添益快线货币
交易代码	000049
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年10月12日
报告期末基金份额总额	104,462,544,720.00

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10月1日 - 2017年12月31日)
1.本期每万份收益	1,074,293.0762
2.本期利润	1,074,293.0762
3.期末基金资产净值	104,462,544,720.00

注:1.本期基金收益分配是按日结转份额的。

2.上述基金业绩指标不包括持有人认购或申购基金所产生的费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 本基金合同生效以来基金累计净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注:1.本基金会同于2014年10月22日生效。

2.按基金合同规定,本基金建仓期为6个月,截至本报告期末,本基金的各项

工银瑞信添益快线货币市场基金

2017年第四季度报告

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

投资比例符合基金合同关于投资范围及投资限制的规定;本基金主要投资于具有良好流动性的工具,包括现金、通知存款、一年以内(含一年)的银行定期存款和大额存单、同业存单及金融债(或回售期限在397天以内含397天)的债券、资产支持证券、中期票据;期限在一年以内(含一年)的债券回购、期限在一年以内(含一年)的同业存单、期限在一年以内(含一年)的中央银行票据、短期融资券,及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他货币市场工具。

但同时本基金面对市场的导向难度仍然较大,货币环境维持中性,并且防范金融风险对于银行仍将继续。在年底资金面和同业都一定波动的情况下,四季度货币市场收益率呈现上升趋势,12月末至12月22日,央行222bp至542bp,期间国债收益率从0.96%上升至1.68%,一年期AAA级金融收益率从4.53%升至2.22%,上升69bp。

四季度,本基金将针对客户需求以及宏观经济和货币市场的判断,积极应对客户在月末和季末的流动性需求,合理安排组合的现金流,并在确定流动性的前提下,通过调整资产配置的时点安排,增厚组合收益率,同时本基金一直严控债券配置比例。

4.5 报告期内企业的业绩表现

报告期内,本基金的净值增长率为1.0209%,业绩比较基准收益率为0.3403%。

4.6 报告期内基金持有数量或基金资产净值情况说明

本基金在报告期内没有触及于2017年10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 占基金总资产的比例(%)

序号	项目	占基金总资产的比例(%)
1	固收类投资	66,159,464,561.03
2	货币类投资	66,159,464,561.03
3	货币类投资	100.00

注:由于四舍五入的原因,基金资产占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

5.2 报告期末持有的处于摊销期的国债情况

本基金在报告期内没有触及于2017年10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。

5.3 报告期末持有的处于摊销期的金融债情况

本基金在报告期内没有触及于2017年10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。

5.4 报告期末持有的处于摊销期的资产支持证券情况

本基金在报告期内没有触及于2017年10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。

5.5 报告期末持有的处于摊销期的中期票据情况

本基金在报告期内没有触及于2017年10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。

5.6 报告期末持有的处于摊销期的同业存单情况

本基金在报告期内没有触及于2017年10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。

5.7 报告期末持有的处于摊销期的资产支持券情况

本基金在报告期内没有触及于2017年10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。

5.8 报告期末持有的处于摊销期的资产支持票据情况

本基金在报告期内没有触及于2017年10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。

5.9 报告期末持有的处于摊销期的资产支持计划情况

本基金在报告期内没有触及于2017年10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。

5.10 报告期末持有的处于摊销期的资产支持信托情况

本基金在报告期内没有触及于2017年10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。

5.11 报告期末持有的处于摊销期的资产支持证券合

计金额为0.00元。

5.12 报告期末持有的处于摊销期的资产支持证券合

计金额为0.00元。

5.13 报告期末持有的处于摊销期的资产支持证券合

计金额为0.00元。

5.14 报告期末持有的处于摊销期的资产支持证券合

计金额为0.00元。

5.15 报告期末持有的处于摊销期的资产支持证券合

计金额为0.00元。

5.16 报告期末持有的处于摊销期的资产支持证券合

计金额为0.00元。

5.17 报告期末持有的处于摊销期的资产支持证券合

计金额为0.00元。

5.18 报告期末持有的处于摊销期的资产支持证券合

计金额为0.00元。

5.19 报告期末持有的处于摊销期的资产支持证券合

计金额为0.00元。

5.20 报告期末持有的处于摊销期的资产支持证券合

计金额为0.00元。

5.21 报告期末持有的处于摊销期的资产支持证券合

计金额为0.00元。

5.22 报告期末持有的处于摊销期的资产支持证券合

计金额为0.00元。

5.23 报告期末持有的处于摊销期的资产支持证券合

计金额为0.00元。

5.24 报告期末持有的处于摊销期的资产支持证券合

计金额为0.00元。

5.25 报告期末持有的处于摊销期的资产支持证券合

计金额为0.00元。

5.26 报告期末持有的处于摊销期的资产支持证券合

计金额为0.00元。

5.27 报告期末持有的处于摊销期的资产支持证券合

计金额为0.00元。

5.28 报告期末持有的处于摊销期的资产支持证券合

计金额为0.00元。

5.29 报告期末持有的处于摊销期的资产支持证券合

计金额为0.00元。

5.30 报告期末持有的处于摊销期的资产支持证券合

计金额为0.00元。

5.31 报告期末持有的处于摊销期的资产支持证券合

计金额为0.00元。

5.32 报告期末持有的处于摊销期的资产支持证券合

计金额为0.00元。

5.33 报告期末持有的处于摊销期的资产支持证券合

计金额为0.00元。

5.34 报告期末持有的处于摊销期的资产支持证券合

计金额为0.00元。

5.35 报告期末持有的处于摊销期的资产支持证券合

计金额为0.00元。

5.36 报告期末持有的处于摊销期的资产支持证券合

计金额为0.00元。

5.37 报告期末持有的处于摊销期的资产支持证券合

计金额为0.00元。

5.38 报告期末持有的处于摊销期的资产支持证券合

计金额为0.00元。

5.39 报告期末持有的处于摊销期的资产支持证券合

计金额为0.00元。

5.40 报告期末持有的处于摊销期的资产支持证券合

计金额为0.00元。

5.41 报告期末持有的处于摊销期的资产支持证券合

计金额为0.00元。

5.42 报告期末持有的处于摊销期的资产支持证券合

计金额为0.00元。

5.43 报告期末持有的处于摊销期的资产支持证券合

计金额为0.00元。

5.44 报告期末持有的处于摊销期的资产支持证券合

计金额为0.00元。

5.45 报告期末持有的处于摊销期的资产支持证券合

计金额为0.00元。

5.46 报告期末持有的处于摊销期的资产支持证券合

计金额为0.00元。

5.47 报告期末持有的处于摊销期的资产支持证券合

计金额为0.00元。

5.48 报告期末持有的处于摊销期的资产支持证券合

计金额为0.00元。

5.49 报告期末持有的处于摊销期的资产支持证券合

计金额为0.00元。

5.50 报告期末持有的处于摊销期的资产支持证券合