工银瑞信瑞丰纯债半年定期开放债券型证券投资基金

2017年第四季度报告

基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人:中国光大银行股份有限公司
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,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。

基金托管人中国光大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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	工银瑞丰纯债半年定开债券
交易代码	002600
基金运作方式	契约型、定期开放式
基金合同生效日	2016年4月22日
报告期末基金份额总额	363,620,484.84份
投资目标	在严格控制风险的基础上,通过对固定收益类证券的积极投资,追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	封闭期内,本基金将考察市场利率的动态变化及预期变化,对GDP、CPI、PPI、外汇收支及国际市场流动性动态情况等引起利率变化的相关因素进行深入的研究,分析国际与国内宏观经济运行的可能情景,并在此基础上判断包括财政政策以及国内和主要发达国家及地区的货币政策、汇率政策在内的宏观经济政策取向,对市场利率水平和收益率曲线未来的变化趋势做出预测和判断,结合债券市场资金及债券的供求结构及变化趋势,确定固定收益类资产的久期配置。在利率预期分析及其久期配置范围确定的基础上,通过情景分析和历史预测相结合的方法,"自上而下"在债券一级市场和二级市场,银行间市场和交易所市场,银行存款、信用债、政府债券等资产类别之间进行类属配置,进而确定具有最优风险收益特征的资产组合。 开放期内,本基金为保持较高的组合流动性,方便投资人安排投资,在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下,将主要投资于高流动性的投资品种,减小基金净值的波动。
业绩比较基准	中债综合财富(总值)指数。
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	中国光大银行股份有限公司

§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10月1日 - 2017年12月31日)
1.本期已实现收益	-8,615,991.61
2.本期利润	-3,935,584.61
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0070
4.期末基金资产净值	365,685,890.90
5.期末基金份额净值	1.006

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。

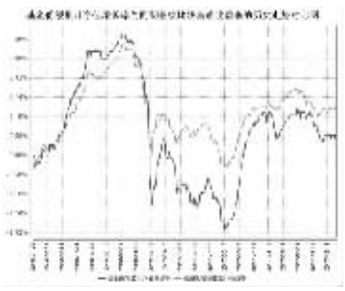
3、所列数据截止到报告期最后一日,无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

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	-0.59%	0.07%	-0.43%	0.06%	-0.16%	0.01%

3.2.2 目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4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:债券资产占基金资产的比例不低于80%,但在每次开放期前一个月、开放期及开放期结束后一个月的期间内,基金投资不受上述比例限制;开放期内,每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后,本基金所持有现金及到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%;在非开放期,本基金不受该比例的限制。

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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
陆欣	固定收益部副总监,本基金的基金经理	2016年4月22日	-	12	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2017年12月22日,担任工银纯债债券型基金基金经理;2016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;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基金基金经理;2016年5月5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25日至今,担任工银瑞信瑞享纯债债券型证券投资基金基金经理;2016年12月16日至2017年12月22日,担任工银瑞信国债纯债债券型证券投资基金基金经理。
李娜	本基金的基金经理	2017年4月14日	-	9	曾在中国工商银行总行担任交易员。2016年加入工银瑞信,现任固定收益部基金经理。2017年1月24日至今,担任工银瑞信恒丰纯债债券型证券投资基金基金经理;2017年1月24日至今,担任工银瑞信恒泰纯债债券型证券投资基金基金经理;2017年4月14日至今,担任工银瑞信纯债定期开放债券型证券投资基金基金经理;2017年5月27日至今,担任工银瑞信纯债定期开放债券型证券投资基金基金经理;2017年6月8日至今,担任工银瑞信瑞利两年封闭式债券型证券投资基金基金经理;2017年6月27日至今,担任工银瑞信丰实三年定期开放债券型证券投资基金基金经理。

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;未出现清算不到位的情况,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,2017年经济增长韧性较强,超出市场的预期,即使在房地产严控加码及供给侧改革升级的总基调下,国内经济表现强劲,基建投资对经济带动较为显著,企业盈利能力增强,制造业保持平稳增长,中采制造业PMI持续在高位振荡。物价总体保持平稳,CPI同比回落后有所上行,但通胀风险可控;PPI同比冲高回落,仍处于相对较高水平。央行延续稳健中性的货币政策,货币市场资金利率小幅抬升,季节性的资金紧张也略超市场预期,短端利率在年末大幅抬升。海外方面,全球经济复苏势头强劲,美国、欧洲的内需较强,制造业指数也连创新高,对出口也带来一定的支撑作用。

整体来看,2017年债券收益率大幅度上行。10年国债利率上行78bp至3.88%;10年国开债利率上行112bp至4.82%;3年、5年AAA评级中票分别上行147bp和150bp。

瑞丰纯债半年定期开放基金根据基金开放期申赎情况减持资产规模,降低杠杆及久期;进入新的封闭期后,适度增加短期信用债券持仓,提高杠杆水平。

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-0.59%,业绩比较基准收益率为-0.43%。

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	620,322,748.20	97.86
	其中:债券	620,322,748.20	97.86
	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	4,910,573.23	0.77
8	其他资产	8,629,796.07	1.36
9	合计	633,863,117.50	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港股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	公允价值(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	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	493,092,748.20	134.84
5	企业短期融资券	9,996,000.00	2.73
6	中期票据	58,734,000.00	16.06
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	58,500,000.00	16.00
9	其他	-	-
10	合计	620,322,748.20	169.63

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	111709484	17浦发银行CD484	600,000	58,500,000.00	16.00
2	122331	14营口港	350,000	34,877,500.00	9.54
3	122402	15城建01	350,010	34,816,789.80	9.52
4	136236	16金隅02	350,000	32,924,500.00	9.00
5	136168	16建发01	350,000	32,830,000.00	8.98

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	32,439.01
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	8,597,357.06
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,629,796.07

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	702,729,653.80
报告期期间基金总申购份额	213,866.75
减:报告期期间基金总赎回份额	339,323,035.71
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	363,620,484.84

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	30,548,879.84
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	30,548,879.84
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	8.40

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	序号	报告期内持有基金份额变化情况 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	报告期末持有基金情况 持有份额	份额占比
机构	1	20171001-20171127	306,121,428.57	0.00	306,121,428.57	0.00	0.00%
	2	20171001-20171231	300,209,000.00	0.00	0.00	300,209,000.00	82.56%
个人	-	-	-	-	-	-	-
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、中国证监会准予工银瑞信瑞丰纯债半年定期开放债券型证券投资基金募集申请的注册文件;

2、《工银瑞信瑞丰纯债半年定期开放债券型证券投资基金合同》;

3、《工银瑞信瑞丰纯债半年定期开放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。

工银瑞信安盈货币市场基金

2017年第四季度报告

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。

基金托管人中国民生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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	工银安盈货币
交易代码	002679
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年4月26日
报告期末基金份额总额	771,003,764.20份
投资目标	在控制风险并保持资产流动性的基础上,力争实现超过业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金将采取利率策略、信用策略、相对价值策略等积极投资策略,在严格控制风险的前提下,发掘和利用市场失衡提供的投资机会,实现组合增值。
业绩比较基准	中国人民银行公布的七天通知存款税后利率。
风险收益特征	本基金为货币市场基金,在所有证券投资基金中,是风险相对较低的基金产品。在一般情况下,其风险与预期收益均低于一般债券型基金,也低于混合型基金与股票型基金。
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	工银安盈货币A / 工银安盈货币B
下属分级基金的交易代码	002679 / 002680
报告期末下属分级基金的份额总额	3,764.20份 / 771,000,000.00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10月1日 - 2017年12月31日)	
	工银安盈货币A	工银安盈货币B
1. 本期已实现收益	42.45	305,753,982.10
2. 本期利润	42.45	305,753,982.10
3. 期末基金资产净值	3,764.20	771,000,000.00

注:1、本基金收益分配是现金分红,每日分配、按季支付。

2、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。

3、本期已实现收益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,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

4、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收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

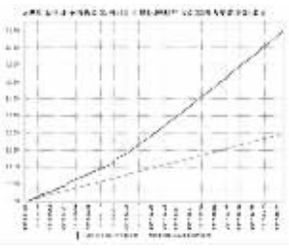
工银安盈货币A

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	1.0325%	0.0010%	0.3403%	0.0000%	0.6922%	0.0010%

工银安盈货币B

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	1.0969%	0.0010%	0.3403%	0.0000%	0.7566%	0.0010%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益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4月26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:本基金主要投资于具有良好流动性的工具,包括现金;期限在1年以内(含1年)的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单;剩余期限在397天以内(含397天)的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券及法律法规或中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。

§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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
谷衡	固定收益部副总监,本基金的基金经理	2016年4月26日	-	12	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2017年12月22日,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5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25日至今,担任工银瑞信瑞享纯债债券型证券投资基金基金经理;2016年12月16日至2017年12月22日,担任工银瑞信国债纯债债券型证券投资基金基金经理。
姚娜伟	本基金的基金经理	2017年4月14日	-	4	2013年加入工银瑞信,现任固定收益部高级研究员、基金经理。2016年9月19日至今,担任工银瑞信财富快线货币市场基金基金经理;2016年9月19日至今,担任工银瑞信稳益快线货币市场基金基金经理;2016年9月19日至今,担任工银瑞信现金快线货币市场基金基金经理;2017年4月14日至今,担任工银瑞信安盈货币市场基金基金经理。

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;未出现清算不到位的情况,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

与三季度相比,四季度宏观基本面延续了走弱的态势,但仍展现出较强的韧性。从需求端来看,房地产投资、制造业投资、消费的增速均有所回落,经济的韧性主要来自于基建和出口。不过2018年在税收和土地出让收入增长放缓、地方债务整肃推进的背景下,基建投资大概率会走弱。出口方面,四季度较三季度有所改善,结合12月PMI新出口订单、发达国家PMI数据超预期的表现来看,全球贸易高景气的状态在延续。整体上来看,在控宏观杠杆率的基调下,债务扩张的速度将逐渐向名义GDP收敛,高度依赖杠杆的地产和基建受到抑制,带动内需的回落,但地产低库存、土地供应增加等因素意味着内需回落的幅度相对有限。

但同时基本面对货币政策的传导难度仍然大,货币环境维持中性,并且防金融风险和去杠杆仍在进行中。在年底资金面和同业都有一定波动的情形下,四季度货币市场资产收益率上行,至12月末,7天回购利率从3.20%上行222bp至5.42%,一年期国开债收益率从3.96%上升72bp至4.68%,一年期AAA短融收益率从4.53%升至5.22%,上行69bp。

四季度,本基金通过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要求,合理安排组合的现金流,并在确保流动性的前提下,通过对存款和债券配置的时点安排,增厚组合收益率,同时本基金一直严控债券配置的信用资质。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内,工银安盈货币A份额净值增长率为1.0325%,工银安盈货币B份额净值增长率为1.0969%,业绩比较基准收益率为0.3403%。

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	固定收益投资	652,343,281.19	72.73
	其中:债券	652,343,281.19	72.73
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	98,460,587.69	10.98
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	144,203,243.64	16.08
4	其他资产	1,926,471.60	0.21
5	合计	896,933,584.12	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	固定收益投资	652,343,281.19	72.73
	其中:债券	652,343,281.19	72.73
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	98,460,587.69	10.98
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	144,203,243.64	16.08
4	其他资产	1,926,471.60	0.21
5	合计	896,933,584.12	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 报告期末按债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	4.49
	其中:买断式回购融资	-
序号	项目	金额(元) / 占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	122,999,738.50 / 15.95
	其中:买断式回购融资	- / -

注:报告期内债券融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产余额比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本基金债券正回购的资金余额没有超过基金资产净值20%的情况。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	87
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	106
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	6

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本报告期内无投资组合平均剩余期限超过120天情况。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	5.48	15.95
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	83.89	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-120天	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)-397天(含)	26.72	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		116.09	15.95

5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余存续期限未超过240天。

5.5 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	39,923,367.77	5.18
	其中:政策性金融债	39,923,367.77	5.18
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	10,001,006.93	1.30
6	中期票据	-	-
7	同业存单	602,418,906.49	78.13
8	其他	-	-
9	合计	652,343,281.19	84.61
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

注:上表中,债券的成本包括债券面值和折溢价。

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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111709480	17浦发银行CD480	1,000,000	99,137,836.61	12.86
2	111710635	17兴业银行CD635	1,000,000	99,132,816.09	12.86
3	111770366	17宁波银行CD233	1,000,000	99,127,267.97	12.86
4	111717290	17光大银行CD290	1,000,000	98,160,170.95	12.73
5	111711517	17平安银行CD517	700,000	69,392,684.34	9.00
6	111713096	17浙商银行CD096	500,000	48,936,526.38	6.35
7	111711528	17平安银行CD528	500,000	48,915,943.73	6.34
8	170204	17国开04	400,000	39,923,367.77	5.18
9	111721148	17渤海银行CD148	400,000	39,615,660.42	5.14
10	041750028	17桑德CP002	100,000	10,001,006.93	1.30

注:上表中,债券的成本包括债券面值和折溢价。

5.7 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.0038%
报告期内偏离度的最低值	-0.0905%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0135%

注:上表中"偏离情况"根据报告期内各交易日数据计算。

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本报告期内,本基金负偏离度的绝对值未达到0.25%。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

本报告期内,本基金正偏离度的绝对值未达到0.5%。

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。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 本基金采用固定分额净值,基金账面份额净值始终保持为人民币1.00元。 本基金估值采用摊余成本法,即估值对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内按实际利率法进行摊销,每日计提收益或损失。

5.9.2 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。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	27,172.84
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	1,899,298.76
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	1,926,471.60

5.9.4 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	工银安盈货币A	工银安盈货币B
报告期期初基金份额总额	5,066.20	71,500,000,000.00
报告期期间基金总申购份额	-	441,000,000.00
报告期期间基金总赎回份额	1,302.00	71,170,000,000.00
报告期期末基金份额总额	3,764.20	771,000,000.00

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	序号	报告期内持有基金份额变化情况 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	报告期末持有基金情况 持有份额	份额占比
机构	1	20171001-20171231	30,000,344,000.00	0.00	0.00	30,000,344,000.00	100.00%
个人	-	-	-	-	-	-	-
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

本基金的基金管理人于2017年10月26日发布分红公告,向截至2017年10月27日止在本基金注册登记人登记在册的全体持有人,按每10份基金份额分配红利人民币0.005元;本基金的基金管理人于2017年11月27日发布分红公告,向截至2017年11月28日止在本基金注册登记人登记在册的全体持有人,按每10份基金份额分配红利人民币0.017元;本基金的基金管理人于2017年12月25日发布分红公告,向截至2017年12月26日止在本基金注册登记人登记在册的全体持有人,按每10份基金份额分配红利人民币0.019元。

§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安盈货币市场基金募集申请的注册文件;

2、《工银瑞信安盈货币市场基金基金合同》;

3、《工银瑞信安盈货币市场基金托管协议》;

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。