工银瑞信泰享三年理财债券型证券投资基金

2019年第一季度报告

基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人:宁波银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一九年四月二十二日

§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、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人宁波银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年4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2019年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	工银泰享三年理财债券
交易代码	002750
基金运作方式	契约型开放式(本基金以封闭期和开放期滚动的方式运作)
基金合同生效日	2016年5月5日
报告期末基金份额总额	30,000,354,756.96份
投资目标	本基金采取严格的买入持有到期投资策略,投资于剩余期限(或回售期限)不超过基金剩余封闭期的固定收益类工具,力求基金资产的稳健增值。
投资策略	本基金以封闭期为周期进行投资运作,在封闭期内,本基金采用买入并持有策略构建投资组合,对所投资固定收益品种的剩余期限与基金的剩余封闭期进行期限匹配,投资于剩余期限(或回售期限)不超过基金剩余封闭期的固定收益类工具,一般情况下,本基金持有的债券品种和结构在封闭期内不会发生变化。
业绩比较基准	在每个封闭期,本基金的业绩比较基准为该封闭期起始日的中国人民银行公布并执行的金融机构三年期定期存款利率(税后)。
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	宁波银行股份有限公司

§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(2019年1月1日 - 2019年3月31日)
1.本期已实现收益	216,632,542.99
2.本期利润	216,632,542.99
3.加权平均基金份额本期利润	0.0072
4.期末基金资产净值	30,028,612,227.49
5.期末基金份额净值	1.0009

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。

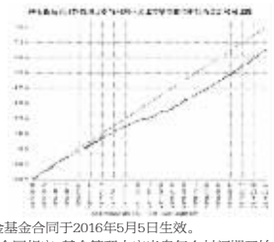
3、所列数据截止到报告期最后一日,无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

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	0.72%	0.01%	0.68%	0.01%	0.04%	0.00%

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、本基金基金合同于2016年5月5日生效。

2、根据基金合同规定,基金管理人应当自每个封闭期开始之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。截至报告期末,本基金的投资符合基金合同关于投资范围及投资限制的规定:本基金对债券的投资比例不低于基金资产的80%。但应开放期流动性需要,为保护基金份额持有人利益,每个开放期开始前六个月至开放期结束后六个月内不受前述比例限制。

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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈桂都	本基金的基金经理	2016年9月2日	-	11	2008年加入工银瑞信,现任固定收益部基金经理。2016年9月2日至今,担任工银瑞信智享纯债债券型证券投资基金基金经理;2016年9月2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;2017年4月14日至2018年3月20日,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4月14日至今,担任工银瑞信丰淳半年定期开放债券型证券投资基金(自2017年9月23日起变更为工银瑞信丰淳半年定期开放债券型发起式证券投资基金)基金经理;2017年4月14日至2018年3月28日,担任工银瑞信恒享纯债债券型证券投资基金基金经理;2017年6月23日至2018年3月28日,担任工银瑞信丰益一年定期开放债券型证券投资基金基金经理;2017年6月23日至今,担任工银瑞信中高等级信用债债券型证券投资基金基金经理;2018年6月12日,担任工银瑞信稳景定期开放债券型发起式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》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》、《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《公司交易管理办法》、《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超过该证券当日成交量的5%的情况有2次。投资组合经理因投资组合的投资策略而发生同日反向交易,未导致不公平交易和利益输送。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

一季度我国经济在整体仍然面临较大下行压力的情况下,通过货币政策、财政政策等协同发力,实现了较为平稳的开局。信贷投放积极,社会融资规模存量同比回升至10%以上;固定资产投资增速继续回升,房地产投资和基建投资成为主要的拉动力量;景气指标改善,官方制造业PMI和财新制造业PMI双双回升至荣枯线以上。但一些构成经济下行压力的因素仍未消退,包括全球经济增长前景不明朗,出口增速面临较大下行压力;国内居民部门杠杆在过去一段时间较快上升,对消费增长的抑制作用有所显现;企业盈利增速下行,可能对制造业投资造成不利影响等等。

受益于央行启动全面降准等宽松措施,债券市场流动性充裕,一季度债券收益率总体下行,短端下行幅度更大,收益率曲线变陡。10年期国开债收益率下行6bp至3.58%,5年国开下行8bp至3.42%,1年期国开债下行20bp至2.55%,10年-1年的期限利差从89bp扩张至103bp。5年AAA信用债收益率由4.06%下行至3.96%,3年AAA信用债收益率由3.81%降至3.62%,1年AAA信用债收益率下行38bp至3.21%。

泰享三年理财债券基金本报告期内继续持有高等级信用债券,组合运行平稳,净值较平稳增长。

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0.72%,业绩比较基准收益率为0.68%。

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	20,970,030,827.33	56.63
	其中:债券	20,970,030,827.33	56.63
	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:买断式逆回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	15,533,550,997.22	42.00
8	其他资产	506,513,767.72	1.37
9	合计	37,030,095,392.27	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境内股票投资。

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

无。

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	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	99,994,320.71	0.33
	其中:政策性金融债	99,994,320.71	0.33
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	880,222,973.57	2.93
6	中期票据	2,060,519,482.32	6.86
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	5,898,014,588.02	19.64
9	地方政府债	12,031,279,462.71	40.07
10	其他	-	-
11	合计	20,970,030,827.33	69.83

注:由于四舍五入的原因摊余成本占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

5.5 报告期末按摊余成本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)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	130887	16贵州01	30,000,000	2,999,814,156.02	9.99
2	130895	16黑龙01	21,400,000	2,139,895,488.72	7.13
2	101651023	16中石油MTN002	14,000,000	1,400,133,661.08	4.66
4	130891	16贵州05	13,200,000	1,319,934,861.21	4.40
5	130905	16河南01	10,000,000	999,920,336.66	3.33

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受到调查以及处罚的情况的说明

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 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	506,513,767.72
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	506,513,767.72

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	30,000,354,756.96
报告期期间基金总申购份额	-
减:报告期期间基金总赎回份额	-
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	30,000,354,756.96

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

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§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				报告期末持有基金情况	
		报告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	持有份额	份额占比
机构	1	20190101-20190331	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

本报告期内,本基金利润分配情况如下:

本基金本期于2019年1月29日发布分红公告,每10份派发红利0.021元,共计派发红利63,000,744.81元,权益登记日为2019年1月30日。

本基金本期于2019年2月26日发布分红公告,每10份派发红利0.023元,共计派发红利69,000,815.38元,权益登记日为2019年2月27日。

本基金本期于2019年3月27日发布分红公告,每10份派发红利0.025元,共计派发红利75,000,885.91元,权益登记日为2019年3月28日。

§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泰享三年理财债券型证券投资基金募集申请的注册文件;

2、《工银瑞信泰享三年理财债券型证券投资基金基金合同》;

3、《工银瑞信泰享三年理财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媒介上披露的各项公告。

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。

工银瑞信添颐债券型证券投资基金

2019年第一季度报告

基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人:中国民生银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一九年四月二十二日

§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2019年4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2019年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	工银添颐债券
交易代码	481114
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年8月10日
报告期末基金份额总额	324,973,442.52份
投资目标	在保持基金资产流动性与控制基金风险的前提下,力争实现超越业绩比较基准的长期投资回报,为投资者提供多元投资的工具。
投资策略	本基金将在资产配置策略的基础上,通过固定收益类品种投资策略构筑债券组合的早稳收益,通过积极的权益类资产投资策略追求基金资产的增值型回报。
业绩比较基准	五年期定期存款利率+1.5%。
风险收益特征	本基金为债券型基金,预期收益和风险水平高于货币市场基金,低于混合型基金与股票型基金;因为本基金可以配置二级市场股票,所以预期收益和风险水平高于投资范围不含二级市场股票的债券型基金。
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	工银添颐债券A / 工银添颐债券B
下属分级基金的交易代码	481114 / 481914
报告期末下属分级基金的份额总额	110,938,464.42份 / 214,034,978.10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(2019年1月1日 - 2019年3月31日)	
	工银添颐债券A	工银添颐债券B
1.本期已实现收益	2,468,384.81	3,379,111.10
2.本期利润	14,580,185.50	21,836,887.07
3.加权平均基金份额本期利润	0.1273	0.1167
4.期末基金资产净值	232,968,442.38	427,573,080.92
5.期末基金份额净值	2.100	1.998

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

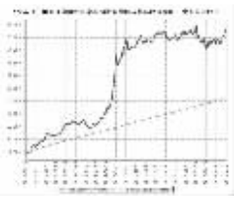
工银添颐债券A

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	6.44%	0.39%	1.54%	0.02%	4.90%	0.37%

工银添颐债券B

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	6.38%	0.39%	1.54%	0.02%	4.79%	0.37%

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、本基金基金合同于2011年8月10日生效。

2、根据基金合同规定,本基金建仓期为6个月。截至本报告期末,本基金的投资符合基金合同的相关规定:本基金投资债券等固定收益类资产占基金资产的比例不低于90%;股票等权益类资产占基金资产的比例不超过20%,现金及到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杜海涛	副总经理,本基金的基金经理	2011年8月10日	-	22	先后在安盟基金管理有限公司担任基金经理助理,招商基金管理有限公司担任招商现金增值基金基金经理;2006年加入工银瑞信,现任公司副总经理,兼任子公司-工银瑞信资产管理(国际)有限公司董事;2006年9月21日至2011年4月21日,担任工银货币市场基金基金经理;2010年8月16日至2012年1月10日,担任工银双利债券型基金基金经理;2012年6月23日至2017年7月19日,担任工银纯债定期开放基金基金经理;2013年8月14日至2015年11月11日,担任工银月月薪定期支付债券型基金基金经理;2015年8月11日至今,担任工银增利收益债券型基金基金经理;2013年8月30日至今,担任工银瑞信添颐债券型证券投资基金基金经理;2013年1月7日至今,担任工银货币市场基金基金经理;2013年10月31日至2018年4月23日,担任工银瑞信福债券基金基金经理;2014年1月27日至2018年6月5日,担任工银新金钱市场基金基金经理;2015年4月17日至2018年4月4日,担任工银启润混合配置混合型基金基金经理;2018年2月27日至今,担任工银瑞信添颐债券型证券投资基金基金经理。
宋炳坤	权益投资总监,本基金的基金经理	2012年2月14日	-	15	曾任中信建投证券有限公司研究员,2007年加入工银瑞信,现任权益投资总监。2012年2月14日至今,担任工银瑞信添颐债券型证券投资基金基金经理;2013年1月18日至今,担任工银双利债券基金基金经理;2013年1月28日至2014年12月31日,担任工银瑞信6个月定期开放债券型证券投资基金基金经理;2014年10月29日至今,担任工银瑞信稳健成长混合型证券投资基金基金经理;2014年11月18日至2018年4月11日,担任工银瑞信稳景平年定期开放债券型证券投资基金基金经理;2015年2月16日至2017年12月22日,担任工银瑞信略转债主题股票基金基金经理;2017年4月12日至2018年7月26日,担任工银瑞信中国制造2025股票证券投资基金基金经理。
景晓达	养老金投资中心投资部副总监,本基金的基金经理	2018年10月23日	-	11	先后在上海绿地集团担任战略职员,在安信证券股份有限公司担任固定收益分析师;2013年加入工银瑞信,现任养老金投资中心投资部副总监,基金经理。2018年10月23日至今,担任工银瑞信添颐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》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》、《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《公司交易管理办法》、《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超过该证券当日成交量的5%的情况有2次。投资组合经理因投资组合的投资策略而发生同日反向交易,未导致不公平交易和利益输送。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

一季度,国内经济相对稳定,全球主要经济体工业活动下滑明显。与此相适应,全球央行开始逐渐转向宽松的货币政策。债券方面,收益率维持稳定。整体收益率曲线的绝对水平处在历史偏低的分位数,但低等级信用债仍然受到市场风险偏好影响,定价偏高。此外,转债资产出现明显上涨。股票方面,整体市场估值得以明显修复,从去年四季度非常低的估值水平修复至接近历史中位数的位置。并且,估值修复的范围是非常广泛的。

报告期内本基金根据宏观经济和资产价格的状态,权益资产保持较高仓位,同时债券资产久期相对谨慎。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内,工银添颐债券A份额净值增长率为6.44%,工银添颐债券B份额净值增长率为6.33%,业绩比较基准收益率为1.54%。

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	125,691,205.75	17.75
	其中:股票	125,691,205.75	17.75
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	561,662,798.48	79.34
	其中:债券	529,396,898.48	74.78
	资产支持证券	32,265,900.00	4.56
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:买断式逆回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	13,660,753.98	1.93
8	其他资产	6,906,781.51	0.98
9	合计	707,921,539.72	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

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	4,641,687.00	0.70
C	制造业	58,686,808.70	8.88
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	8,359,871.26	1.27
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	35,922,730.63	5.44
K	房地产业	15,865,544.16	2.40
L	租赁和商务服务业	2,214,364.00	0.34
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	125,691,205.75	19.03

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。

5.2.2 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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	251,422	19,384,636.20	2.93
2	600019	宝钢股份	1,871,700	13,532,391.00	2.05
3	600104	上汽集团	475,360	12,392,635.20	1.88
4	000002	万科A	300,978	9,246,044.16	1.40
5	000963	华东医药	256,202	8,359,871.26	1.27
6	600585	海螺水泥	204,175	7,795,401.50	1.18
7	601009	南京银行	968,681	7,662,266.71	1.16
8	002146	荣盛发展	588,400	6,619,500.00	1.00
9	600519	贵州茅台	7,094	6,058,205.06	0.92
10	600309	万华化学	112,900	5,140,337.00	0.78

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	61,860,537.20	9.37
2	央行票据	-	-
3	金融债券	40,036,000.00	6.06
	其中:政策性金融债	40,036,000.00	6.06
4	企业债券	51,262,452.20	7.76
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	111,095,000.00	16.82
7	可转债(可交换债)	215,030,909.08	32.55
8	同业存单	-	-
9	地方政府债	50,112,000.00	7.59
10	其他	-	-
11	合计	529,396,898.48	80.15

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	010107	21国债(7)	599,540	61,860,537.20	9.37
2	132013	17宝武EB	420,840	42,953,138.80	6.50
3	160215	16国开15	400,000	40,036,000.00	6.06
4	136361	15云潞Z2	300,000	30,126,000.00	4.56
5	132008	17山高EB	299,100	29,939,910.00	4.53

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。

5.6 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

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	139254	万科28A1	70,000	7,059,500.00	1.07
2	139261	万科29A1	70,000	7,053,200.00	1.07
3	139217	链融7A1	50,000	5,045,000.00	0.76
4	139248	万科26A1	50,000	5,044,500.00	0.76
5	139227	龙腾优10	50,000	5,042,000.00	0.76
6	135502	链融01A1	20,000	2,014,400.00	0.30
7	139318	万科31A1	10,000	1,007,300.00	0.15

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受到调查以及处罚的情况的说明

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 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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	92,939.70
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	6,774,373.61
5	应收申购款	39,468.20
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,906,781.51

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	132013	17宝武EB	42,953,138.80	6.50
2	132008	17山高EB	29,939,910.00	4.53
3	132007	16凤凰EB	28,161,615.50	4.26
4	132006	16联新EB	26,168,486.40	3.96
5	110031	航信转债	17,368,010.90	2.63
6	132005	15国资EB	11,570,385.00	1.75
7	132015	18中油EB	11,476,688.10	1.74
8	132012	17巨化EB	10,557,434.40	1.60
9	113014	林洋转债	2,449,764.10	0.37
10	120001	16江铃EB	685,708.80	0.10
11	113017	宁波转债	447,773.30	0.07

注:上表包含期末持有的处于转股期的可转换债券和可交换债券明细。

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

项目	工银添颐债券A	工银添颐债券B
报告期期初基金份额总额	118,152,910.73	195,464,933.16
报告期期间基金总申购份额	3,677,184.33	55,340,257.75
减:报告期期间基金总赎回份额	10,891,630.64	36,770,212.81
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	110,938,464.42	214,034,978.10

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	10,416,962.43
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,416,962.43
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	3.21

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§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

无。

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、中国证监会批准工银瑞信添颐债券型证券投资基金设立的文件;

2、《工银瑞信添颐债券型证券投资基金基金合同》;

3、《工银瑞信添颐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和营业