

## 工银瑞信添福债券型证券投资基金

### 2015 第一季度报告

2015年3月31日

基金管理人：工银瑞信基金管理有限公司  
基金管理人：中国工商银行股份有限公司  
报告送出日期：2015年4月17日

1.1 重要提示  
基金管理人及基金托管人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。  
基金管理人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2015年4月16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。  
基金管理人保证以诚信为原则，勤勉尽责地履行信息披露义务，保证所披露信息真实、准确、完整。  
本报告所载数据截至2015年3月31日止。

1.2 基金产品概况

|           |                  |
|-----------|------------------|
| 基金名称      | 工银瑞信添福债券型证券投资基金  |
| 基金代码      | 000761           |
| 基金运作方式    | 契约型开放式           |
| 基金合同生效日   | 2014年07月23日      |
| 报告期末基金总份额 | 1,018,139,648.03 |

3.1 主要财务指标

| 主要财务指标         |        | 报告期(2015年1月1日-2015年3月31日) |                | 单位:人民币元 |  |
|----------------|--------|---------------------------|----------------|---------|--|
| 1.本期已实现收益      | 工银瑞信添福 | 80,827,311.10             | 13,553,747.03  |         |  |
| 2.本期利润         | 工银瑞信添福 | 44,182,025.30             | 18,402,378.94  |         |  |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 工银瑞信添福 | 0.0064                    | 0.0069         |         |  |
| 4.期末基金份额净值     | 工银瑞信添福 | 1.157,178.1912            | 396,281,233.49 |         |  |
| 5.期末基金份额净值     | 工银瑞信添福 | 1.526                     | 1,514          |         |  |

3.2 业绩比较基准

| 阶段    | 净值增长率 | 净值增长率标准差 | 业绩比较基准收益率 | 业绩比较基准收益率标准差 | ①-③   | ②-④   |
|-------|-------|----------|-----------|--------------|-------|-------|
| 过去三个月 | 5.46% | 0.81%    | 1.36%     | 0.02%        | 4.10% | 0.79% |
| 过去六个月 | 5.36% | 0.81%    | 1.36%     | 0.02%        | 4.00% | 0.79% |

3.3 投资组合报告

3.3.1 报告期末基金资产组合情况

| 代码 | 名称   | 数量               | 公允价值(元)      | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------|------------------|--------------|--------------|
| 1  | 国债   | 500,000          | 500,000.00   | 4.91         |
| 2  | 央行票据 | 1,000,000        | 1,000,000.00 | 9.82         |
| 3  | 金融债券 | 279,179,000.00   | 18.04        |              |
| 4  | 企业债券 | 699,488,300.04   | 45.19        |              |
| 5  | 中期票据 | 20,667,500.00    | 13.29        |              |
| 6  | 其他   | 21,430,000.00    | 17.66        |              |
| 7  | 回购   | 100,186,132.20   | 6.47         |              |
| 8  | 其他   | 1,526,281,013.24 | 100.56       |              |

3.3.2 报告期末基金资产组合情况

| 代码 | 名称   | 数量               | 公允价值(元)      | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------|------------------|--------------|--------------|
| 1  | 国债   | 500,000          | 500,000.00   | 4.91         |
| 2  | 央行票据 | 1,000,000        | 1,000,000.00 | 9.82         |
| 3  | 金融债券 | 279,179,000.00   | 18.04        |              |
| 4  | 企业债券 | 699,488,300.04   | 45.19        |              |
| 5  | 中期票据 | 20,667,500.00    | 13.29        |              |
| 6  | 其他   | 21,430,000.00    | 17.66        |              |
| 7  | 回购   | 100,186,132.20   | 6.47         |              |
| 8  | 其他   | 1,526,281,013.24 | 100.56       |              |

3.3.3 报告期末基金资产组合情况

| 代码 | 名称   | 数量               | 公允价值(元)      | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------|------------------|--------------|--------------|
| 1  | 国债   | 500,000          | 500,000.00   | 4.91         |
| 2  | 央行票据 | 1,000,000        | 1,000,000.00 | 9.82         |
| 3  | 金融债券 | 279,179,000.00   | 18.04        |              |
| 4  | 企业债券 | 699,488,300.04   | 45.19        |              |
| 5  | 中期票据 | 20,667,500.00    | 13.29        |              |
| 6  | 其他   | 21,430,000.00    | 17.66        |              |
| 7  | 回购   | 100,186,132.20   | 6.47         |              |
| 8  | 其他   | 1,526,281,013.24 | 100.56       |              |

3.3.4 报告期末基金资产组合情况

| 代码 | 名称   | 数量               | 公允价值(元)      | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------|------------------|--------------|--------------|
| 1  | 国债   | 500,000          | 500,000.00   | 4.91         |
| 2  | 央行票据 | 1,000,000        | 1,000,000.00 | 9.82         |
| 3  | 金融债券 | 279,179,000.00   | 18.04        |              |
| 4  | 企业债券 | 699,488,300.04   | 45.19        |              |
| 5  | 中期票据 | 20,667,500.00    | 13.29        |              |
| 6  | 其他   | 21,430,000.00    | 17.66        |              |
| 7  | 回购   | 100,186,132.20   | 6.47         |              |
| 8  | 其他   | 1,526,281,013.24 | 100.56       |              |

3.3.5 报告期末基金资产组合情况

| 代码 | 名称   | 数量               | 公允价值(元)      | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------|------------------|--------------|--------------|
| 1  | 国债   | 500,000          | 500,000.00   | 4.91         |
| 2  | 央行票据 | 1,000,000        | 1,000,000.00 | 9.82         |
| 3  | 金融债券 | 279,179,000.00   | 18.04        |              |
| 4  | 企业债券 | 699,488,300.04   | 45.19        |              |
| 5  | 中期票据 | 20,667,500.00    | 13.29        |              |
| 6  | 其他   | 21,430,000.00    | 17.66        |              |
| 7  | 回购   | 100,186,132.20   | 6.47         |              |
| 8  | 其他   | 1,526,281,013.24 | 100.56       |              |

3.3.6 报告期末基金资产组合情况

| 代码 | 名称   | 数量               | 公允价值(元)      | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------|------------------|--------------|--------------|
| 1  | 国债   | 500,000          | 500,000.00   | 4.91         |
| 2  | 央行票据 | 1,000,000        | 1,000,000.00 | 9.82         |
| 3  | 金融债券 | 279,179,000.00   | 18.04        |              |
| 4  | 企业债券 | 699,488,300.04   | 45.19        |              |
| 5  | 中期票据 | 20,667,500.00    | 13.29        |              |
| 6  | 其他   | 21,430,000.00    | 17.66        |              |
| 7  | 回购   | 100,186,132.20   | 6.47         |              |
| 8  | 其他   | 1,526,281,013.24 | 100.56       |              |

3.3.7 报告期末基金资产组合情况

| 代码 | 名称   | 数量               | 公允价值(元)      | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------|------------------|--------------|--------------|
| 1  | 国债   | 500,000          | 500,000.00   | 4.91         |
| 2  | 央行票据 | 1,000,000        | 1,000,000.00 | 9.82         |
| 3  | 金融债券 | 279,179,000.00   | 18.04        |              |
| 4  | 企业债券 | 699,488,300.04   | 45.19        |              |
| 5  | 中期票据 | 20,667,500.00    | 13.29        |              |
| 6  | 其他   | 21,430,000.00    | 17.66        |              |
| 7  | 回购   | 100,186,132.20   | 6.47         |              |
| 8  | 其他   | 1,526,281,013.24 | 100.56       |              |

3.3.8 报告期末基金资产组合情况

| 代码 | 名称   | 数量               | 公允价值(元)      | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------|------------------|--------------|--------------|
| 1  | 国债   | 500,000          | 500,000.00   | 4.91         |
| 2  | 央行票据 | 1,000,000        | 1,000,000.00 | 9.82         |
| 3  | 金融债券 | 279,179,000.00   | 18.04        |              |
| 4  | 企业债券 | 699,488,300.04   | 45.19        |              |
| 5  | 中期票据 | 20,667,500.00    | 13.29        |              |
| 6  | 其他   | 21,430,000.00    | 17.66        |              |
| 7  | 回购   | 100,186,132.20   | 6.47         |              |
| 8  | 其他   | 1,526,281,013.24 | 100.56       |              |

3.3.9 报告期末基金资产组合情况

| 代码 | 名称   | 数量               | 公允价值(元)      | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------|------------------|--------------|--------------|
| 1  | 国债   | 500,000          | 500,000.00   | 4.91         |
| 2  | 央行票据 | 1,000,000        | 1,000,000.00 | 9.82         |
| 3  | 金融债券 | 279,179,000.00   | 18.04        |              |
| 4  | 企业债券 | 699,488,300.04   | 45.19        |              |
| 5  | 中期票据 | 20,667,500.00    | 13.29        |              |
| 6  | 其他   | 21,430,000.00    | 17.66        |              |
| 7  | 回购   | 100,186,132.20   | 6.47         |              |
| 8  | 其他   | 1,526,281,013.24 | 100.56       |              |

3.3.10 报告期末基金资产组合情况

| 代码 | 名称   | 数量               | 公允价值(元)      | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------|------------------|--------------|--------------|
| 1  | 国债   | 500,000          | 500,000.00   | 4.91         |
| 2  | 央行票据 | 1,000,000        | 1,000,000.00 | 9.82         |
| 3  | 金融债券 | 279,179,000.00   | 18.04        |              |
| 4  | 企业债券 | 699,488,300.04   | 45.19        |              |
| 5  | 中期票据 | 20,667,500.00    | 13.29        |              |
| 6  | 其他   | 21,430,000.00    | 17.66        |              |
| 7  | 回购   | 100,186,132.20   | 6.47         |              |
| 8  | 其他   | 1,526,281,013.24 | 100.56       |              |

3.3.11 报告期末基金资产组合情况

| 代码 | 名称   | 数量               | 公允价值(元)      | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------|------------------|--------------|--------------|
| 1  | 国债   | 500,000          | 500,000.00   | 4.91         |
| 2  | 央行票据 | 1,000,000        | 1,000,000.00 | 9.82         |
| 3  | 金融债券 | 279,179,000.00   | 18.04        |              |
| 4  | 企业债券 | 699,488,300.04   | 45.19        |              |
| 5  | 中期票据 | 20,667,500.00    | 13.29        |              |
| 6  | 其他   | 21,430,000.00    | 17.66        |              |
| 7  | 回购   | 100,186,132.20   | 6.47         |              |
| 8  | 其他   | 1,526,281,013.24 | 100.56       |              |

3.3.12 报告期末基金资产组合情况

| 代码 | 名称   | 数量               | 公允价值(元)      | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------|------------------|--------------|--------------|
| 1  | 国债   | 500,000          | 500,000.00   | 4.91         |
| 2  | 央行票据 | 1,000,000        | 1,000,000.00 | 9.82         |
| 3  | 金融债券 | 279,179,000.00   | 18.04        |              |
| 4  | 企业债券 | 699,488,300.04   | 45.19        |              |
| 5  | 中期票据 | 20,667,500.00    | 13.29        |              |
| 6  | 其他   | 21,430,000.00    | 17.66        |              |
| 7  | 回购   | 100,186,132.20   | 6.47         |              |
| 8  | 其他   | 1,526,281,013.24 | 100.56       |              |

3.3.13 报告期末基金资产组合情况

| 代码 | 名称   | 数量               | 公允价值(元)      | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------|------------------|--------------|--------------|
| 1  | 国债   | 500,000          | 500,000.00   | 4.91         |
| 2  | 央行票据 | 1,000,000        | 1,000,000.00 | 9.82         |
| 3  | 金融债券 | 279,179,000.00   | 18.04        |              |
| 4  | 企业债券 | 699,488,300.04   | 45.19        |              |
| 5  | 中期票据 | 20,667,500.00    | 13.29        |              |
| 6  | 其他   | 21,430,000.00    | 17.66        |              |
| 7  | 回购   | 100,186,132.20   | 6.47         |              |
| 8  | 其他   | 1,526,281,013.24 | 100.56       |              |

3.3.14 报告期末基金资产组合情况

| 代码 | 名称   | 数量               | 公允价值(元)      | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------|------------------|--------------|--------------|
| 1  | 国债   | 500,000          | 500,000.00   | 4.91         |
| 2  | 央行票据 | 1,000,000        | 1,000,000.00 | 9.82         |
| 3  | 金融债券 | 279,179,000.00   | 18.04        |              |
| 4  | 企业债券 | 699,488,300.04   | 45.19        |              |
| 5  | 中期票据 | 20,667,500.00    | 13.29        |              |
| 6  | 其他   | 21,430,000.00    | 17.66        |              |
| 7  | 回购   | 100,186,132.20   | 6.47         |              |
| 8  | 其他   | 1,526,281,013.24 | 100.56       |              |

3.3.15 报告期末基金资产组合情况

| 代码 | 名称   | 数量               | 公允价值(元)      | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------|------------------|--------------|--------------|
| 1  | 国债   | 500,000          | 500,000.00   | 4.91         |
| 2  | 央行票据 | 1,000,000        | 1,000,000.00 | 9.82         |
| 3  | 金融债券 | 279,179,000.00   | 18.04        |              |
| 4  | 企业债券 | 699,488,300.04   | 45.19        |              |
| 5  | 中期票据 | 20,667,500.00    | 13.29        |              |
| 6  | 其他   | 21,430,000.00    | 17.66        |              |
| 7  | 回购   | 100,186,132.20   | 6.47         |              |
| 8  | 其他   | 1,526,281,013.24 | 100.56       |              |

3.3.16 报告期末基金资产组合情况

| 代码 | 名称   | 数量               | 公允价值(元)      | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------|------------------|--------------|--------------|
| 1  | 国债   | 500,000          | 500,000.00   | 4.91         |
| 2  | 央行票据 | 1,000,000        | 1,000,000.00 | 9.82         |
| 3  | 金融债券 | 279,179,000.00   | 18.04        |              |
| 4  | 企业债券 | 699,488,300.04   | 45.19        |              |
| 5  | 中期票据 | 20,667,500.00    | 13.29        |              |
| 6  | 其他   | 21,430,000.00    | 17.66        |              |
| 7  | 回购   | 100,186,132.20   | 6.47         |              |
| 8  | 其他   | 1,526,281,013.24 | 100.56       |              |

3.3.17 报告期末基金资产组合情况

| 代码 | 名称   | 数量               | 公允价值(元)      | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------|------------------|--------------|--------------|
| 1  | 国债   | 500,000          | 500,000.00   | 4.91         |
| 2  | 央行票据 | 1,000,000        | 1,000,000.00 | 9.82         |
| 3  | 金融债券 | 279,179,000.00   | 18.04        |              |
| 4  | 企业债券 | 699,488,300.04   | 45.19        |              |
| 5  | 中期票据 | 20,667,500.00    | 13.29        |              |
| 6  | 其他   | 21,430,000.00    | 17.66        |              |
| 7  | 回购   | 100,186,132.20   | 6.47         |              |
| 8  | 其他   | 1,526,281,013.24 | 100.56       |              |

3.3.18 报告期末基金资产组合情况

| 代码 | 名称   | 数量               | 公允价值(元)      | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------|------------------|--------------|--------------|
| 1  | 国债   | 500,000          | 500,000.00   | 4.91         |
| 2  | 央行票据 | 1,000,000        | 1,000,000.00 | 9.82         |
| 3  | 金融债券 | 279,179,000.00   | 18.04        |              |
| 4  | 企业债券 | 699,488,300.04   | 45.19        |              |
| 5  | 中期票据 | 20,667,500.00    | 13.29        |              |
| 6  | 其他   | 21,430,000.00    | 17.66        |              |
| 7  | 回购   | 100,186,132.20   | 6.47         |              |
| 8  | 其他   | 1,526,281,013.24 | 100.56       |              |

3.3.19 报告期末基金资产组合情况

| 代码 | 名称   | 数量               | 公允价值(元)      | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------|------------------|--------------|--------------|
| 1  | 国债   | 500,000          | 500,000.00   | 4.91         |
| 2  | 央行票据 | 1,000,000        | 1,000,000.00 | 9.82         |
| 3  | 金融债券 | 279,179,000.00   | 18.04        |              |
| 4  | 企业债券 | 699,488,300.04   | 45.19        |              |
| 5  | 中期票据 | 20,667,500.00    | 13.29        |              |
| 6  | 其他   | 21,430,000.00    | 17.66        |              |
| 7  | 回购   | 100,186,132.20   | 6.47         |              |
| 8  | 其他   | 1,526,281,013.24 | 100.56       |              |

3.3.20 报告期末基金资产组合情况

| 代码 | 名称   | 数量             | 公允价值(元)      | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------|----------------|--------------|--------------|
| 1  | 国债   | 500,000        | 500,000.00   | 4.91         |
| 2  | 央行票据 | 1,000,000      | 1,000,000.00 | 9.82         |
| 3  | 金融债券 | 279,179,000.00 | 18.04        |              |
| 4  | 企业债券 | 699,488,300.04 | 45.19        |              |
| 5  | 中期票据 | 20,667,500.00  | 13.29        |              |
| 6  | 其他   | 21,430,000.00  | 17.66        |              |
| 7  | 回购   |                |              |              |