

工银瑞信14天理财债券型发起式证券投资基金

2015 半年度 报告摘要

2015年6月30日

本报告由基金管理人负责编写,基金资产净值、利润、分配、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等... 不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规...

2.1 基金基本情况
基金代码: 485120
基金运作方式: 契约型开放式
基金合同生效日: 2012年10月26日

2.2 基金主要财务指标和基金净值表现
主要财务指标: 本期期末资产净值 10,843,955,398.13
本期期末基金份额净值 1.0000

3.1 期间回报和业绩指标
报告期(2015年1月1日至2015年6月30日)
本期已实现收益 81,548,362.48
本期净利润 81,548,362.48

3.2 本期主要投资指标和持仓
基金资产净值 2,799,736,543.93
持仓资产净值 1,000.00

3.3 主要财务指标和基金净值表现
基金代码: 工银14天理财债券发起A
报告期(2015年1月1日至2015年6月30日)

3.4 主要财务指标和基金净值表现
基金代码: 工银14天理财债券发起B
报告期(2015年1月1日至2015年6月30日)

3.5 主要财务指标和基金净值表现
基金代码: 工银14天理财债券发起C
报告期(2015年1月1日至2015年6月30日)

3.6 主要财务指标和基金净值表现
基金代码: 工银14天理财债券发起D
报告期(2015年1月1日至2015年6月30日)

3.7 主要财务指标和基金净值表现
基金代码: 工银14天理财债券发起E
报告期(2015年1月1日至2015年6月30日)

3.8 主要财务指标和基金净值表现
基金代码: 工银14天理财债券发起F
报告期(2015年1月1日至2015年6月30日)

3.9 主要财务指标和基金净值表现
基金代码: 工银14天理财债券发起G
报告期(2015年1月1日至2015年6月30日)

3.10 主要财务指标和基金净值表现
基金代码: 工银14天理财债券发起H
报告期(2015年1月1日至2015年6月30日)

3.11 主要财务指标和基金净值表现
基金代码: 工银14天理财债券发起I
报告期(2015年1月1日至2015年6月30日)

3.12 主要财务指标和基金净值表现
基金代码: 工银14天理财债券发起J
报告期(2015年1月1日至2015年6月30日)

3.13 主要财务指标和基金净值表现
基金代码: 工银14天理财债券发起K
报告期(2015年1月1日至2015年6月30日)

3.14 主要财务指标和基金净值表现
基金代码: 工银14天理财债券发起L
报告期(2015年1月1日至2015年6月30日)

3.15 主要财务指标和基金净值表现
基金代码: 工银14天理财债券发起M
报告期(2015年1月1日至2015年6月30日)

3.16 主要财务指标和基金净值表现
基金代码: 工银14天理财债券发起N
报告期(2015年1月1日至2015年6月30日)

3.17 主要财务指标和基金净值表现
基金代码: 工银14天理财债券发起O
报告期(2015年1月1日至2015年6月30日)

3.18 主要财务指标和基金净值表现
基金代码: 工银14天理财债券发起P
报告期(2015年1月1日至2015年6月30日)

3.19 主要财务指标和基金净值表现
基金代码: 工银14天理财债券发起Q
报告期(2015年1月1日至2015年6月30日)

3.20 主要财务指标和基金净值表现
基金代码: 工银14天理财债券发起R
报告期(2015年1月1日至2015年6月30日)

3.21 主要财务指标和基金净值表现
基金代码: 工银14天理财债券发起S
报告期(2015年1月1日至2015年6月30日)

3.22 主要财务指标和基金净值表现
基金代码: 工银14天理财债券发起T
报告期(2015年1月1日至2015年6月30日)

3.23 主要财务指标和基金净值表现
基金代码: 工银14天理财债券发起U
报告期(2015年1月1日至2015年6月30日)

3.24 主要财务指标和基金净值表现
基金代码: 工银14天理财债券发起V
报告期(2015年1月1日至2015年6月30日)

3.25 主要财务指标和基金净值表现
基金代码: 工银14天理财债券发起W
报告期(2015年1月1日至2015年6月30日)

资产负债表
资产: 银行存款 4,579,721,103.86
结算备付金 2,647,450,022.41
交易性金融资产 3,839,457,848.82

利润表
营业收入 83,108,218.15
公允价值变动收益 1,849,053.30
其他综合收益 212,313.60

现金流量表
经营活动产生的现金流量净额 1,764,607,290.08
投资活动产生的现金流量净额 -1,786,982,100.00
筹资活动产生的现金流量净额 1,276,235,627.67

所有者权益变动表
本期期末所有者权益合计 10,843,955,398.13
上期期末所有者权益合计 10,843,955,398.13

资产负债表
资产: 银行存款 4,579,721,103.86
结算备付金 2,647,450,022.41
交易性金融资产 3,839,457,848.82

利润表
营业收入 83,108,218.15
公允价值变动收益 1,849,053.30
其他综合收益 212,313.60

现金流量表
经营活动产生的现金流量净额 1,764,607,290.08
投资活动产生的现金流量净额 -1,786,982,100.00
筹资活动产生的现金流量净额 1,276,235,627.67

所有者权益变动表
本期期末所有者权益合计 10,843,955,398.13
上期期末所有者权益合计 10,843,955,398.13

资产负债表
资产: 银行存款 4,579,721,103.86
结算备付金 2,647,450,022.41
交易性金融资产 3,839,457,848.82

利润表
营业收入 83,108,218.15
公允价值变动收益 1,849,053.30
其他综合收益 212,313.60

现金流量表
经营活动产生的现金流量净额 1,764,607,290.08
投资活动产生的现金流量净额 -1,786,982,100.00
筹资活动产生的现金流量净额 1,276,235,627.67

所有者权益变动表
本期期末所有者权益合计 10,843,955,398.13
上期期末所有者权益合计 10,843,955,398.13

资产负债表
资产: 银行存款 4,579,721,103.86
结算备付金 2,647,450,022.41
交易性金融资产 3,839,457,848.82

利润表
营业收入 83,108,218.15
公允价值变动收益 1,849,053.30
其他综合收益 212,313.60

现金流量表
经营活动产生的现金流量净额 1,764,607,290.08
投资活动产生的现金流量净额 -1,786,982,100.00
筹资活动产生的现金流量净额 1,276,235,627.67

所有者权益变动表
本期期末所有者权益合计 10,843,955,398.13
上期期末所有者权益合计 10,843,955,398.13

资产负债表
资产: 银行存款 4,579,721,103.86
结算备付金 2,647,450,022.41
交易性金融资产 3,839,457,848.82

利润表
营业收入 83,108,218.15
公允价值变动收益 1,849,053.30
其他综合收益 212,313.60

现金流量表
经营活动产生的现金流量净额 1,764,607,290.08
投资活动产生的现金流量净额 -1,786,982,100.00
筹资活动产生的现金流量净额 1,276,235,627.67

所有者权益变动表
本期期末所有者权益合计 10,843,955,398.13
上期期末所有者权益合计 10,843,955,398.13

资产负债表
资产: 银行存款 4,579,721,103.86
结算备付金 2,647,450,022.41
交易性金融资产 3,839,457,848.82

利润表
营业收入 83,108,218.15
公允价值变动收益 1,849,053.30
其他综合收益 212,313.60

资产负债表
资产: 银行存款 4,579,721,103.86
结算备付金 2,647,450,022.41
交易性金融资产 3,839,457,848.82

利润表
营业收入 83,108,218.15
公允价值变动收益 1,849,053.30
其他综合收益 212,313.60

现金流量表
经营活动产生的现金流量净额 1,764,607,290.08
投资活动产生的现金流量净额 -1,786,982,100.00
筹资活动产生的现金流量净额 1,276,235,627.67

所有者权益变动表
本期期末所有者权益合计 10,843,955,398.13
上期期末所有者权益合计 10,843,955,398.13

资产负债表
资产: 银行存款 4,579,721,103.86
结算备付金 2,647,450,022.41
交易性金融资产 3,839,457,848.82

利润表
营业收入 83,108,218.15
公允价值变动收益 1,849,053.30
其他综合收益 212,313.60

现金流量表
经营活动产生的现金流量净额 1,764,607,290.08
投资活动产生的现金流量净额 -1,786,982,100.00
筹资活动产生的现金流量净额 1,276,235,627.67

所有者权益变动表
本期期末所有者权益合计 10,843,955,398.13
上期期末所有者权益合计 10,843,955,398.13

资产负债表
资产: 银行存款 4,579,721,103.86
结算备付金 2,647,450,022.41
交易性金融资产 3,839,457,848.82

利润表
营业收入 83,108,218.15
公允价值变动收益 1,849,053.30
其他综合收益 212,313.60

现金流量表
经营活动产生的现金流量净额 1,764,607,290.08
投资活动产生的现金流量净额 -1,786,982,100.00
筹资活动产生的现金流量净额 1,276,235,627.67

所有者权益变动表
本期期末所有者权益合计 10,843,955,398.13
上期期末所有者权益合计 10,843,955,398.13

资产负债表
资产: 银行存款 4,579,721,103.86
结算备付金 2,647,450,022.41
交易性金融资产 3,839,457,848.82

利润表
营业收入 83,108,218.15
公允价值变动收益 1,849,053.30
其他综合收益 212,313.60

现金流量表
经营活动产生的现金流量净额 1,764,607,290.08
投资活动产生的现金流量净额 -1,786,982,100.00
筹资活动产生的现金流量净额 1,276,235,627.67

所有者权益变动表
本期期末所有者权益合计 10,843,955,398.13
上期期末所有者权益合计 10,843,955,398.13

资产负债表
资产: 银行存款 4,579,721,103.86
结算备付金 2,647,450,022.41
交易性金融资产 3,839,457,848.82

利润表
营业收入 83,108,218.15
公允价值变动收益 1,849,053.30
其他综合收益 212,313.60

现金流量表
经营活动产生的现金流量净额 1,764,607,290.08
投资活动产生的现金流量净额 -1,786,982,100.00
筹资活动产生的现金流量净额 1,276,235,627.67

所有者权益变动表
本期期末所有者权益合计 10,843,955,398.13
上期期末所有者权益合计 10,843,955,398.13

资产负债表
资产: 银行存款 4,579,721,103.86
结算备付金 2,647,450,022.41
交易性金融资产 3,839,457,848.82

利润表
营业收入 83,108,218.15
公允价值变动收益 1,849,053.30
其他综合收益 212,313.60

7.2 债券回购融资情况
序号 项目 金额 占基金资产净值的比例(%)
1 报告期内债券回购融资余额 23.30

7.3 基金投资组合平均剩余期限基本情况
项目 天数
报告期内债券回购融资余额 127
报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例(%) 109

7.4 期末投资组合品种分类下的债券投资组合
序号 债券品种 摊余成本 占基金资产净值的比例(%)
1 国债债券 -- --

7.5 期末投资组合品种分类下的债券投资组合
序号 债券品种 摊余成本 占基金资产净值的比例(%)
1 国债债券 -- --

7.6 影子定价与摊余成本法确定的基金资产净值偏离度
序号 偏离度绝对值 偏离度绝对值的绝对值占基金资产净值的比例(%)
1 0.0000 0.0000

7.7 投资组合平均剩余期限
序号 项目 金额 占基金资产净值的比例(%)
1 报告期内债券回购融资余额 23.30

7.8 投资组合平均剩余期限
序号 项目 金额 占基金资产净值的比例(%)
1 报告期内债券回购融资余额 23.30

7.9 投资组合平均剩余期限
序号 项目 金额 占基金资产净值的比例(%)
1 报告期内债券回购融资余额 23.30

7.10 投资组合平均剩余期限
序号 项目 金额 占基金资产净值的比例(%)
1 报告期内债券回购融资余额 23.30

7.11 投资组合平均剩余期限
序号 项目 金额 占基金资产净值的比例(%)
1 报告期内债券回购融资余额 23.30

7.12 投资组合平均剩余期限
序号 项目 金额 占基金资产净值的比例(%)
1 报告期内债券回购融资余额 23.30

7.13 投资组合平均剩余期限
序号 项目 金额 占基金资产净值的比例(%)
1 报告期内债券回购融资余额 23.30

7.14 投资组合平均剩余期限
序号 项目 金额 占基金资产净值的比例(%)
1 报告期内债券回购融资余额 23.30

7.15 投资组合平均剩余期限
序号 项目 金额 占基金资产净值的比例(%)
1 报告期内债券回购融资余额 23.30

7.16 投资组合平均剩余期限
序号 项目 金额 占基金资产净值的比例(%)
1 报告期内债券回购融资余额 23.30

7.17 投资组合平均剩余期限
序号 项目 金额 占基金资产净值的比例(%)
1 报告期内债券回购融资余额 23.30

7.18 投资组合平均剩余期限
序号 项目 金额 占基金资产净值的比例(%)
1 报告期内债券回购融资余额 23.30

7.19 投资组合平均剩余期限
序号 项目 金额 占基金资产净值的比例(%)
1 报告期内债券回购融资余额 23.30

7.20 投资组合平均剩余期限
序号 项目 金额 占基金资产净值的比例(%)
1 报告期内债券回购融资余额 23.30

7.21 投资组合平均剩余期限
序号 项目 金额 占基金资产净值的比例(%)
1 报告期内债券回购融资余额 23.30

7.22 投资组合平均剩余期限
序号 项目 金额 占基金资产净值的比例(%)
1 报告期内债券回购融资余额 23.30

7.23 投资组合平均剩余期限
序号 项目 金额 占基金资产净值的比例(%)
1 报告期内债券回购融资余额 23.30

7.24 投资组合平均剩余期限
序号 项目 金额 占基金资产净值的比例(%)
1 报告期内债券回购融资余额 23.30

7.25 投资组合平均剩余期限
序号 项目 金额 占基金资产净值的比例(%)
1 报告期内债券回购融资余额 23.30