# 工银瑞信增强收益债券型证券投资基金

## 2015 第四季度 报告

2015年12月31日

基金管理人：工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人：中国建设银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一六年一月二十日

§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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2016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2015年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

| | | |
|---|---|---|
| 基金简称 | 工银增强收益债券 | |
| 交易代码 | 485105 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2007年5月11日 | |
| 报告期末基金份额总额 | 3,728,342,614.63份 | |
| 投资目标 | 在控制风险与保持资产流动性的基础上，力争基金资产波动性低于业绩比较基准，追求资产的长期稳定增值，获得超过基金业绩比较基准的投资业绩。 | |
| 投资策略 | 在确定的利率策略和期限结构、类属配置策略下，通过固定收益产品的投资来获取稳定的收益。同时适当参与新股发行申购及增发新股申购等风险较低的投资品种，为基金持有人增加收益，实现基金资产的长期稳定增值。 | |
| 业绩比较基准 | 中债-新综合指数（财富）收益率。 | |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率低于混合型基金，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 | 中国建设银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 工银增强收益债券A | 工银增强收益债券B |
| 下属分级基金的交易代码 | 485105 | 485005 |
| 下属分级基金的前端交易代码 | 485105 | – |
| 下属分级基金的后端交易代码 | 485205 | – |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 2,462,442,776.93份 | 1,265,899,837.70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（2015年10月1日 — 2015年12月31日） | |
|---|---|---|
| | 工银增强收益债券A | 工银增强收益债券B |
| 1. 本期已实现收益 | 34,090,267.37 | 20,639,681.25 |
| 2. 本期利润 | 48,310,231.49 | 29,876,388.61 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0323 | 0.0309 |
| 4. 期末基金资产净值 | 2,860,462,125.70 | 1,463,555,151.72 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.1616 | 1.1561 |

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"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2015年12月31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

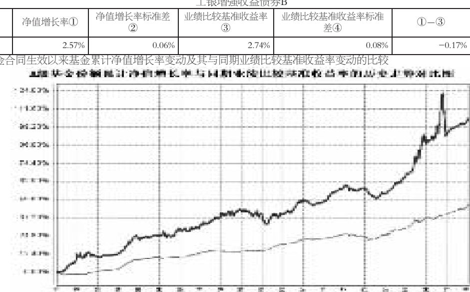
工银增强收益债券A

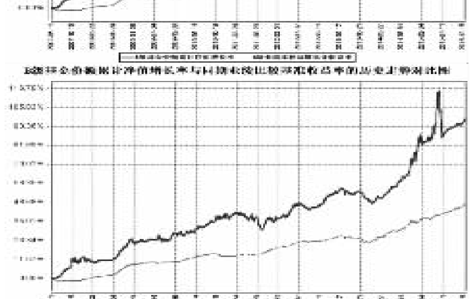
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①–③ | ②–④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 2.68% | 0.06% | 2.74% | 0.08% | –0.06% | –0.02% |

工银增强收益债券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 | 2.57% | 0.06% | 2.74% | 0.08% | –0.17% | –0.02% |

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、本基金合同于2007年5月11日生效。

2、根据基金合同规定，本基金建仓期为3个月。截至本报告期末，本基金各项投资符合基金合同关于投资范围及投资限制的规定：本基金投资于债券类资产（含可转换债券）的比例不低于基金资产的80%，投资于股票等权益类证券的比例不超过基金资产的20%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，投资于可转换债券的比例不超过基金资产净值的30%，本基金股票资产投资只进行首次发行及增发新股投资，不直接从二级市场买入股票。

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 | 投资总监兼固定收益部总监，本基金的基金经理。 | 2007年5月11日 | – | 18 | 先后在宝盈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，现任投资总监兼固定收益部总监； 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；2007年5月11日至今，担任工银增强收益债券型基金基金经理；2011年8月10日至今，担任工银瑞信添颐债券型证券投资基金基金经理；2012年6月21日至今，担任工银纯债定期开放基金基金经理；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；2013年10月31日至今，担任工银瑞信添福债券基金基金经理；2014年1月27日至今，担任工银薪金货币市场基金基金经理；2015年4月17日至今，担任工银总回报灵活配置混合型基金基金经理。 |

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超过该证券当日成交量的5%的情况有3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

2015年四季度，在供给侧改革推动下，国内经济基本面延续疲弱态势，通胀保持低位。随着经济增速下行，稳增长政策持续发力。央行下调存贷款基准利率和存款准备金率，并降低公开市场操作利率。与此同时，财政支出提速，地方政府债务置换积极展开。美联储加息下，汇率对货币政策掣肘仍在，资金利率下行不多，但仍维持宽松态势。

债券方面，供给侧改革下，市场对于中长期经济预期悲观，叠加宽松货币政策，基本面对债市依旧利好。进入12月中旬联储加息靴子落地，机构配置抢跑，收益率加速下行。转债方面，股票市场在情绪超调之后回升企稳，转债市场也有所上行，但在12月末，转债供给放量，转债面临调整压力。

本报告期内本基金根据宏观经济和通胀形势的变化降低组合杠杆，期间拉长组合久期抓住利率波段，继续积极减持低评级债券，同时加大转债仓位。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内，工银瑞信增强收益债券A净值增长率2.68%，工银瑞信增强收益债券B净值增长率2.57%，业绩比较基准收益率为2.74%。

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 | 27,613,000.00 | 0.56 |
| | 其中：股票 | 27,613,000.00 | 0.56 |
| 2 | 基金投资 | – | – |
| 3 | 固定收益投资 | 3,728,456,745.56 | 75.11 |
| | 其中：债券 | 3,728,456,745.56 | 75.11 |
| | 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 | 53,003,853.76 | 1.07 |
| 8 | 其他资产 | 1,155,132,171.07 | 23.27 |
| 9 | 合计 | 4,964,205,770.39 | 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

| 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 | – | – |
| C | 制造业 | – | – |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 11,235,000.00 | 0.26 |
| E | 建筑业 | – | – |
| F | 批发和零售业 | – | – |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 10,260,000.00 | 0.24 |
| 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 | – | – |
| K | 房地产业 | 6,118,000.00 | 0.14 |
| L | 租赁和商务服务业 | – | – |
| 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 | 27,613,000.00 | 0.64 |

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。

5.3 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 | 600023 | 浙能电力 | 1,500,000 | 11,235,000.00 | 0.26 |
| 2 | 600798 | 宁波海运 | 1,500,000 | 10,260,000.00 | 0.24 |
| 3 | 600067 | 冠城大通 | 700,000 | 6,118,000.00 | 0.14 |

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 | 343,798,500.00 | 7.95 |
| 2 | 央行票据 | – | – |
| 3 | 金融债券 | 819,059,000.00 | 18.94 |
| | 其中：政策性金融债 | 704,149,000.00 | 16.28 |
| 4 | 企业债券 | 1,346,499,995.56 | 31.14 |
| 5 | 企业短期融资券 | 19,918,000.00 | 0.46 |
| 6 | 中期票据 | 1,063,044,000.00 | 24.58 |
| 7 | 可转债(可交换债) | 136,137,250.00 | 3.15 |
| 8 | 同业存单 | – | – |
| 9 | 其他 | – | – |
| 10 | 合计 | 3,728,456,745.56 | 86.23 |

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 | 150023 | 15附息国债23 | 1,700,000 | 172,448,000.00 | 3.99 |
| 2 | 020076 | 15贴债02 | 1,550,000 | 151,574,500.00 | 3.51 |
| 3 | 1116001 | 11深发展01 | 1,000,000 | 114,910,000.00 | 2.66 |
| 4 | 150207 | 15国开07 | 1,000,000 | 103,390,000.00 | 2.39 |
| 5 | 150312 | 15进出12 | 1,000,000 | 102,000,000.00 | 2.36 |

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 | 192,602.34 |
| 2 | 应收证券清算款 | 1,078,139,547.54 |
| 3 | 应收股利 | – |
| 4 | 应收利息 | 72,330,592.43 |
| 5 | 应收申购款 | 4,469,428.76 |
| 6 | 其他应收款 | – |
| 7 | 待摊费用 | – |
| 8 | 其他 | – |
| 9 | 合计 | 1,155,132,171.07 |

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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 | 工银增强收益债券A | 工银增强收益债券B |
|---|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 1,346,981,096.75 | 815,824,158.91 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 1,332,567,508.80 | 645,481,500.55 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 217,105,828.62 | 195,405,821.76 |
| 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 | 2,462,442,776.93 | 1,265,899,837.70 |

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 | 46,407,696.13 |
| 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 | 46,407,696.13 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | 1.24 |

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

| 序号 | 交易方式 | 交易日期 | 交易份额（份） | 交易金额（元） | 适用费率 |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 红利发放 | 2015年12月16日 | 0.00 | 6,961,154.42 | 0.00% |
| 合计 | | | 0.00 | 6,961,154.42 | |

无。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

根据基金管理人于2015年12月9日披露的《工银瑞信增强收益债券型证券投资基金第九次分红公告》，2015年12月15日本基金进行了成立以来第九次分红。

§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增强收益债券型证券投资基金设立的文件；

2、《工银瑞信增强收益债券型证券投资基金基金合同》；

3、《工银瑞信增强收益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执照；

5、基金托管人业务资格批件和营业执照；

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处。

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。

# 工银瑞信战略转型主题股票型证券投资基金

## 2015 第四季度 报告

2015年12月31日

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：二〇一六年一月二十日

§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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2016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2015年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 工银战略转型股票 |
| 交易代码 | 000991 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2015年2月16日 |
| 报告期末基金份额总额 | 1,073,379,358.59份 |
| 投资目标 | 深入挖掘并充分理解国内经济增长和战略转型所带来的投资机会，精选具有估值优势的公司股票进行投资，力争实现基金资产的长期稳定增值。 |
| 投资策略 | 本基金将由投资研究团队及时跟踪市场环境变化，根据宏观经济运行态势、宏观经济政策变化、证券市场运行状况、国际市场变化情况等因素的深入研究，判断证券市场的发展趋势，结合行业状况、公司价值性和成长性分析，综合评价各类资产的风险收益水平。在充足的宏观形势判断和策略分析的基础上，采用动态调整策略，在市场上涨阶段中，适当增加权益类资产配置比例，在市场下行周期中，适当降低权益类资产配置比例，力求实现基金财产的长期稳定增值，从而有效提高不同市场状况下基金资产的整体收益水平。 |
| 业绩比较基准 | 80%×中证800指数收益率+20%×中债综合指数收益率。 |
| 风险收益特征 | 本基金为股票型基金，预期收益和风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。 |
| 基金管理人 | 工银瑞信基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国农业银行股份有限公司 |

§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（2015年10月1日 — 2015年12月31日） |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | 118,344,329.91 |
| 2.本期利润 | 259,852,194.62 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.2247 |
| 4.期末基金资产净值 | 1,081,754,597.97 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.008 |

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"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。

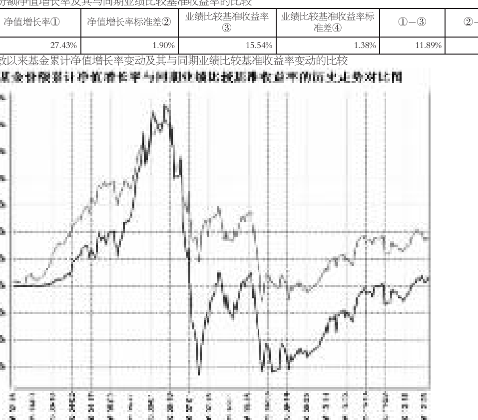
3、所列数据截止到2015年12月31日。

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 | 27.43% | 1.90% | 15.54% | 1.38% | 11.89% | 0.52% |

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2015年2月16日生效。截至报告期末，本基金基金合同生效不满一年。

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：股票占基金资产的比例为80%－95%，其中，投资于本基金界定的战略转型主题股票占非现金资产的比例不低于80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值的5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。

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 | | |
| 杜洋 | 本基金的基金经理 | 2015年2月16日 | – | 5 | 2010年加入工银瑞信，曾任研究部研究员，现任基金经理兼研究部研究员。2015年2月16日至今，担任工银战略转型主题股票基金基金经理。 |
| 宋炳珅 | 权益投资总监兼研究部总监，本基金的基金经理 | 2015年2月16日 | – | 11 | 曾任中信建投证券有限公司研究员；2007年加入工银瑞信，现任权益投资总监兼研究部总监。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5日，担任工银瑞信60天理财债券型基金基金经理；2014年1月20日至今，担任工银瑞信红利混合型证券投资基金基金经理；2014年1月20日至今，担任工银瑞信核心价值混合型证券投资基金基金经理；2014年10月23日至今，担任工银瑞信研究精选股票型基金基金经理；2014年11月18日至今，担任工银医疗保健行业股票型基金基金经理；2015年2月16日至今，担任工银战略转型主题股票基金基金经理。 |

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超过该证券当日成交量的5%的情况有3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

四季度宏观经济有所企稳，流动性依然宽松，汇率出现下跌但市场反应温和，整体上有利于资本市场表现。四季度资本市场表现相对平稳，10月反弹，11月、12月蓄势震荡，风格上仍然是中小盘成长股占优，但12月在保险资金举牌的带动下，蓝筹股也出现明显上涨，市场风格偏向均衡。本基金10月初大幅提高成长股配置比例，在反弹中取得了超越基准的收益，11月中旬以来增配了银行、券商、汽车、电力为代表的蓝筹股，但是由于12月涨幅较大的以地产、保险、医药为主，因此收益并不是十分理想。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金净值增长率为27.43%，业绩比较基准收益率为15.54%。

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 | 997,434,168.61 | 88.96 |
| | 其中：股票 | 997,434,168.61 | 88.96 |
| 2 | 基金投资 | – | – |
| 3 | 固定收益投资 | 56,339,633.40 | 5.02 |
| | 其中：债券 | 56,339,633.40 | 5.02 |
| | 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 | 41,057,863.15 | 3.66 |
| 8 | 其他资产 | 26,378,440.52 | 2.35 |
| 9 | 合计 | 1,121,210,105.68 | 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

| 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 | 16,113,636.00 | 1.49 |
| C | 制造业 | 610,331,947.25 | 56.42 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 76,979,909.70 | 7.12 |
| E | 建筑业 | 42,968,026.13 | 3.97 |
| F | 批发和零售业 | 34,816,874.69 | 3.22 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | – | – |
| H | 住宿和餐饮业 | 11,401,258.50 | 1.05 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 72,405,746.20 | 6.69 |
| J | 金融业 | 112,810,167.14 | 10.43 |
| K | 房地产业 | 19,031,975.00 | 1.76 |
| L | 租赁和商务服务业 | – | – |
| M | 科学研究和技术服务业 | – | – |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 574,628.00 | 0.05 |
| 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 | 997,434,168.61 | 92.21 |

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。

5.3 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 | 300161 | 华中数控 | 1,909,617 | 70,121,136.24 | 6.48 |
| 2 | 000566 | 海南海药 | 1,589,162 | 61,754,835.32 | 5.71 |
| 3 | 601238 | 广汽集团 | 2,307,766 | 52,086,278.62 | 4.81 |
| 4 | 300050 | 世纪鼎利 | 1,438,418 | 51,639,206.20 | 4.77 |
| 5 | 600098 | 广州发展 | 4,040,450 | 51,030,883.50 | 4.72 |
| 6 | 300285 | 国瓷材料 | 1,052,679 | 47,896,894.50 | 4.43 |
| 7 | 601777 | 力帆股份 | 2,668,822 | 46,277,373.48 | 4.28 |
| 8 | 601166 | 兴业银行 | 2,123,014 | 36,239,848.98 | 3.35 |
| 9 | 601012 | 隆基股份 | 2,614,379 | 35,686,273.35 | 3.30 |
| 10 | 300159 | 新研股份 | 2,120,623 | 35,202,341.80 | 3.25 |

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 | 56,339,633.40 | 5.21 |
| | 其中：政策性金融债 | 56,339,633.40 | 5.21 |
| 4 | 企业债券 | – | – |
| 5 | 企业短期融资券 | – | – |
| 6 | 中期票据 | – | – |
| 7 | 可转债 | – | – |
| 8 | 同业存单 | – | – |
| 9 | 其他 | – | – |
| 10 | 合计 | 56,339,633.40 | 5.21 |

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 | 018001 | 国开1301 | 563,340 | 56,339,633.40 | 5.21 |

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投资。

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股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货投资，也无期间损益。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本报告期内，本基金未运用股指期货进行投资。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 3,744,681.63 |
| 2 | 应收证券清算款 | 18,998,937.00 |
| 3 | 应收股利 | – |
| 4 | 应收利息 | 3,261,906.14 |
| 5 | 应收申购款 | 372,915.75 |
| 6 | 其他应收款 | – |
| 7 | 待摊费用 | – |
| 8 | 其他 | – |
| 9 | 合计 | 26,378,440.52 |

5.11.4 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可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值(元) | 占基金资产净值比例（%） | 流通受限情况说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 601012 | 隆基股份 | 35,686,273.35 | 3.30 | 非公开发行 |

5.11.6 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 | 1,221,159,308.20 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 58,414,675.14 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 206,194,624.75 |
| 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 | 1,073,379,358.59 |

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

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

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战略转型主题股票型证券投资基金募集申请的注册文件；

2、《工银瑞信战略转型主题股票型证券投资基金基金合同》；

3、《工银瑞信战略转型主题股票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处。

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。

# 工银瑞信月月薪定期支付债券型证券投资基金

## 2015 第四季度 报告

2015年12月31日

基金管理人：工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人：交通银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一六年一月二十日

§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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2016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2015年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 工银月月薪定期支付债券 |
| 交易代码 | 000236 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2013年8月14日 |
| 报告期末基金份额总额 | 726,186,763.17份 |
| 投资目标 | 在控制风险并保持资产流动性的基础上，通过配置债券等固定收益类金融工具，追求基金资产的长期稳定增值，以获得超过基金业绩比较基准的投资收益。 |
| 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平稳收益，通过积极的权益类资产投资策略追求基金资产的增强型回报。 |
| 业绩比较基准 | 人民币税后三年期银行定期存款利率+1.50%<br>在本基金成立当年，上述"三年期定期存款利率"指基金合同生效当日中国人民银行公布并执行的三年期"金融机构人民币存款基准利率"。其后的每个自然年，"三年期定期存款利率"指当年第一个工作日中国人民银行公布并执行的三年期"金融机构人民币存款基准利率"。 |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，预期收益和预期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，所以预期收益和预期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 | 交通银行股份有限公司 |

§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（2015年10月1日 — 2015年12月31日） |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | 33,024,437.22 |
| 2.本期利润 | 36,444,206.70 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0484 |
| 4.期末基金资产净值 | 1,054,684,479.34 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.452 |

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"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。

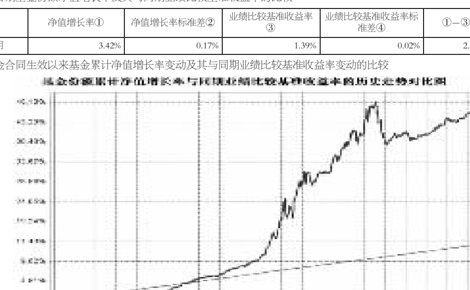
3、所列数据截止到2015年12月31日。

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 | 3.42% | 0.17% | 1.39% | 0.02% | 2.03% | 0.15% |

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2013年8月14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%，股票资产占基金资产的比例不超过20%，本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的3%，基金持有现金或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%。

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 | 投资总监兼固定收益部总监，曾任本基金的基金经理。 | 2013年8月14日 | 2015年11月11日 | 18 | 先后在宝盈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，现任投资总监兼固定收益部总监；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；2007年5月11日至今，担任工银增强收益债券型基金基金经理；2011年8月10日至今，担任工银瑞信添颐债券型证券投资基金基金经理；2012年6月21日至今，担任工银纯债定期开放基金基金经理；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；2013年10月31日至今，担任工银瑞信添福债券基金基金经理；2014年1月27日至今，担任工银薪金货币市场基金基金经理；2015年4月17日至今，担任工银总回报灵活配置混合型基金基金经理。 |
| 郦耀 | 曾任本基金的基金经理 | 2014年1月20日 | 2015年11月11日 | 8 | 先后在德勤华永会计师事务所有限公司担任高级审计员，中国国际金融有限公司担任分析员；2010年加入工银瑞信，曾任研究部研究员。2013年8月26日至今，担任工银瑞信金融地产行业混合型证券投资基金基金经理；2014年1月20日至今，担任工银添福债券基金基金经理；2014年1月20日至2015年11月11日，担任工银月月薪定期支付债券基金基金经理；2014年9月19日起至今，担任工银新财富灵活配置混合型基金基金经理；2015年3月19日至今，担任工银瑞信新金融股票型基金基金经理；2015年3月26日至今，担任工银瑞信美丽城镇主题股票型基金基金经理；2015年4月17日至今，担任工银总回报灵活配置混合型基金基金经理。 |
| 刘琦 | 本基金的基金经理 | 2015年11月10日 | – | 7 | 曾先后在嘉实基金管理有限公司担任基金经理助理、研究员，在嘉实国际担任助理副总裁，在易方达基金担任基金经理。2015年加入工银瑞信，现任固定收益部基金经理。2015年11月10日至今，担任工银月月薪定期支付债券型基金基金经理。 |

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超过该证券当日成交量的5%的情况有3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

2015年四季度，在经济增速下行的情况下，稳增长政策持续发力。央行下调存贷款基准利率和存款准备金率，并降低银行间逆回购中标利率。与此同时，财政支出提速，地方政府债务置换积极展开。

经济基本面和货币宽松环境有利于债券市场，收益率曲线中枢持续下移。

受益于经济改革转型和互联网创新，权益市场上半年整体趋势走强，但进入六月后，由于前期包括场外配资等杠杆资金积累过多，波动显著加剧，情绪超调之后权益市场在四季度回升企稳。

本基金在报告期内根据对于市场变化的判断随后积极调整仓位。具体的，本季度上半期，股灾之后，保持稳健的投资节奏，维持适度的杠杆水平，后半期，积极增持长期债券，保持偏低的权益仓位。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内本基金净值增长率3.42%，业绩比较基准收益率为1.39%。

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 | 116,503,333.57 | 8.33 |
| | 其中：股票 | 116,503,333.57 | 8.33 |
| 2 | 基金投资 | – | – |
| 3 | 固定收益投资 | 1,217,947,420.20 | 87.04 |
| | 其中：债券 | 1,217,947,420.20 | 87.04 |
| | 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 | 24,456,369.56 | 1.75 |
| 8 | 其他资产 | 40,424,150.59 | 2.89 |
| 9 | 合计 | 1,399,331,273.92 | 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

| 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 | 5,052,100.00 | 0.48 |
| C | 制造业 | 53,411,706.07 | 5.06 |
| 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 | – | – |
| 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 | 10,422,930.00 | 0.99 |
| J | 金融业 | 17,037,501.96 | 1.62 |
| K | 房地产业 | 11,040,026.50 | 1.05 |
| L | 租赁和商务服务业 | – | – |
| M | 科学研究和技术服务业 | 1,300,200.00 | 0.12 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 2,055,600.00 | 0.19 |
| 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 | 14,508,169.04 | 1.38 |
| S | 综合 | 1,675,100.00 | 0.16 |
| | 合计 | 116,503,333.57 | 11.05 |

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。

5.3 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 | 601336 | 新华保险 | 145,476 | 7,595,301.96 | 0.72 |
| 2 | 000802 | 北京文化 | 201,943 | 6,841,828.84 | 0.65 |
| 3 | 600000 | 浦发银行 | 340,000 | 6,211,800.00 | 0.59 |
| 4 | 601989 | 中国重工 | 620,000 | 5,828,000.00 | 0.55 |
| 5 | 300230 | 永利股份 | 149,975 | 5,604,565.75 | 0.53 |
| 6 | 300144 | 宋城演艺 | 190,894 | 5,402,300.20 | 0.51 |
| 7 | 300089 | 文化长城 | 130,000 | 5,138,900.00 | 0.49 |
| 8 | 000558 | 莱茵体育 | 184,901 | 5,121,757.70 | 0.49 |
| 9 | 300113 | 顺网科技 | 49,000 | 4,967,130.00 | 0.47 |
| 10 | 002108 | 沧州明珠 | 280,000 | 4,947,600.00 | 0.47 |

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 | 121,293,000.00 | 11.50 |
| 2 | 央行票据 | – | – |
| 3 | 金融债券 | – | – |
| | 其中：政策性金融债 | – | – |
| 4 | 企业债券 | 503,967,473.70 | 47.78 |
| 5 | 企业短期融资券 | – | – |
| 6 | 中期票据 | 549,591,000.00 | 52.11 |
| 7 | 可转债（可交换债） | 43,095,946.50 | 4.09 |
| 8 | 同业存单 | – | – |
| 9 | 其他 | – | – |
| 10 | 合计 | 1,217,947,420.20 | 115.48 |

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 | 101354016 | 13陕交建MTN002 | 700,000 | 71,757,000.00 | 6.80 |
| 2 | 020076 | 15贴债02 | 700,000 | 68,453,000.00 | 6.49 |
| 3 | 101364008 | 13兵团建工MTN001 | 500,000 | 53,465,000.00 | 5.07 |
| 4 | 019516 | 15国债16 | 500,000 | 52,840,000.00 | 5.01 |
| 5 | 124380 | 13曹妃甸 | 500,000 | 52,500,000.00 | 4.98 |

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投资。

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 | 255,541.92 |
| 2 | 应收证券清算款 | 17,684,252.76 |
| 3 | 应收股利 | – |
| 4 | 应收利息 | 21,029,813.02 |
| 5 | 应收申购款 | 1,454,542.89 |
| 6 | 其他应收款 | – |
| 7 | 待摊费用 | – |
| 8 | 其他 | – |
| 9 | 合计 | 40,424,150.59 |

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 | 113008 | 电气转债 | 2,058,166.50 | 0.20 |

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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 | 775,565,896.52 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 48,732,151.06 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 98,111,284.41 |
| 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 | 726,186,763.17 |

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定期支付机制下自动赎回的基金份额以及转换出份额。

§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

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

1.根据基金管理人于2015年11月12日披露的《工银瑞信基金管理有限公司关于增聘基金经理的公告》，自2015年11月10日起，聘任刘琦先生为工银瑞信月月薪定期支付债券型证券投资基金的基金经理。

2.根据基金管理人于2015年11月13日披露的《工银瑞信基金管理有限公司关于变更基金经理的公告》，自2015年11月11日起，杜海涛先生、郦耀先生不再担任工银瑞信月月薪定期支付债券型证券投资基金的基金经理。

§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月月薪定期支付债券型证券投资基金设立的文件；

2、《工银瑞信月月薪定期支付债券型证券投资基金基金合同》；

3、《工银瑞信月月薪定期支付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执照；

5、基金托管人业务资格批件和营业执照；

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。