工银瑞信添益快线货币市场基金

2018 第二季度 报告

2018年6月30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：二〇一八年七月二十日

§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2018年7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2018年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	工银添益快线货币
交易代码	000848
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年10月22日
报告期末基金份额总额	124,972,970,826.34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（2018年4月1日 - 2018年6月30日）
1.本期已实现收益	1,254,795,155.12
2.本期利润	1,254,795,155.12
3.期末基金资产净值	124,972,970,826.34

注：1、本基金收益分配是按日结转份额。

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

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	1.0269%	0.0004%	0.3366%	0.0000%	0.6903%	0.0004%

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2014年10月22日生效。

2、按基金合同规定，本基金建仓期为6个月。截至本报告期末，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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王明	固定收益部副总监，本基金的基金经理	2015年7月10日	-	8	2010年加入工银瑞信，现任固定收益部副总监。2013年11月11日至今，担任工银货币市场基金基金经理；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7月10日至今，担任工银瑞信添益快线货币市场基金基金经理；2015年7月10日至今，担任工银瑞信现金快线货币市场基金基金经理；2016年12月23日至今，担任工银瑞信如意货币市场基金基金经理。
姚雅伟	本基金的基金经理	2016年9月19日	-	5	2013年加入工银瑞信，现任固定收益部基金经理。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，担任工银瑞信现金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

二季度，国内经济数据稳中趋弱，但下行斜率平缓，显示经济韧性犹存，与经济基本面的平稳相对应的则是内外部环境不确定性的增加，外部贸易摩擦的加剧使得我国外需前景趋弱，经常账户顺差存在一定程度压力，这一压力在汇率层面也有反映，内部信用风险的上升则使得企业违约数量有所增加，资本市场风险偏好受到抑制，政策层面，中央政治局4月23日会议提出要推动信贷、股市、债市、汇市、楼市健康发展，凸显决策层防控金融风险的决心和态度。

债券方面，收益率继续大幅下行，1年期国债到期收益率由一季度末的3.32%下行至二季度末的3.05%，10年期国债到期收益率由一季度末的3.74%下行至二季度末的3.50%，延续了一季度的上涨势头，但结构分化明显，受信用风险上升和违约担忧增加的影响，利率债表现明显好于信用债，低等级信用债不涨反跌，3年AA-信用债到期收益率由一季度末的6.47%上行至二季度末的7.04%。股票方面，受风险偏好大幅下降的影响，A股市场普遍下跌，可转债方面，由于股票市场和低等级信用债有所下跌，整体转债类资产也明显下跌。

报告期内本基金根据宏观经济和通胀形势的变化，降低了久期和杠杆水平，继续保持较高的权益仓位。

4.5 报告期内基金的业绩表现

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	3.14	
	其中：买断式回购融资	0.02	
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	13,003,428,813.29	10.40
	其中：买断式回购融资	420,679,017.29	0.34

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	114
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	117
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	82

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	12.02	10.41
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	15.92	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	32.99	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-120天	6.90	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)-397天（含）	42.14	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		109.97	10.41

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	6,411,838,402.57	5.13
	其中：政策性金融债	6,411,838,402.57	5.13
4	企业债券	59,793,481.66	0.05
5	企业短期融资券	759,972,437.31	0.61
6	中期票据	-	-
7	同业存单	44,047,410,473.07	35.25
8	其他	-	-
9	合计	51,279,014,794.61	41.03
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	160208	16国开08	13,200,000	1,308,973,168.60	1.05
2	111808083	18中信银行CD083	13,000,000	1,286,473,393.45	1.03
3	111807131	18招商银行CD131	13,000,000	1,261,181,906.32	1.01
4	111810263	18兴业银行CD263	12,000,000	1,190,979,173.01	0.95
5	111812130	18北京银行CD130	11,000,000	1,066,800,366.55	0.85
6	111818147	18华夏银行CD147	10,000,000	991,975,354.72	0.79
7	111809075	18浦发银行CD075	9,700,000	960,699,465.10	0.77
8	111807132	18招商银行CD132	9,000,000	892,991,875.51	0.71
9	111809181	18浦发银行CD181	9,000,000	892,801,350.18	0.71
10	111816171	18上海银行CD171	8,500,000	844,017,523.82	0.68

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	0.1323%
报告期内偏离度的最低值	0.0110%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0539%

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

序号	债券代码	债券名称	数量（份）	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1889046	18交元1A	4,000,000.00	184,400,000.00	0.15
2	149418	宁远03A2	700,000.00	69,867,000.00	0.06
3	149554	宁远04A2	700,000.00	69,818,000.00	0.06
4	149246	18花05A1	500,000.00	50,045,000.00	0.04
5	149251	花呗56A1	500,000.00	49,800,000.00	0.04
6	149138	18花04A1	400,000.00	40,036,000.00	0.03
7	99V035	万科优06	400,000.00	40,000,000.00	0.03
8	149295	宁远02A2	400,000.00	39,768,000.00	0.03
9	149380	18花06A1	400,000.00	39,624,000.00	0.03
10	149294	宁远02A1	300,000.00	29,925,000.00	0.02

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 本基金采用固定份额净值，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	9,118.26
2	应收证券清算款	5,036,184.82
3	应收利息	629,262,768.20
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	634,308,071.28

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

报告期期初基金份额总额	111,410,111,414.16
报告期期间基金总申购份额	129,297,233,595.71
报告期期间基金总赎回份额	115,734,374,183.53
报告期期末基金份额总额	124,972,970,826.34

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

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、中国证监会准予工银瑞信添益快线货币市场基金募集注册的文件；

2、《工银瑞信添益快线货币市场基金基金合同》；

3、《工银瑞信添益快线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。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。

工银瑞信文体产业股票型证券投资基金

2018 第二季度 报告

2018年6月30日

基金管理人：工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人：兴业银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一八年七月二十日

§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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年7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2018年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	工银文体产业股票
交易代码	001714
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年12月30日
报告期末基金份额总额	297,168,476.96份
投资目标	本基金通过投资于文体产业中具有长期稳定成长性的上市公司，在风险可控的前提下力争获取超越业绩比较基准的收益。
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，根据宏观经济运行走势、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，在宏观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。从所有依据高不同市场状况下基金资产的整体收益水平，在文体产业主题界定的基础上，本基金通过定性分析和定量分析相结合的办法，选择具有长期稳定成长性，且估值水平相对合理的优质上市公司的股票进行重点投资。
业绩比较基准	80%×中证文体指数收益率+20%×中债综合财富（总值）指数收益率。
风险收益特征	基金是股票型基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金、债券型基金与混合型基金。本基金主要投资于文体产业相关股票，其风险高于全市场范围内投资的股票型基金。
基金管理人	工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人	兴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（2018年4月1日 - 2018年6月30日）
1.本期已实现收益	8,887,254.64
2.本期利润	-12,730,061.59
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0536
4.期末基金资产净值	437,014,975.09
5.期末基金份额净值	1.471

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。

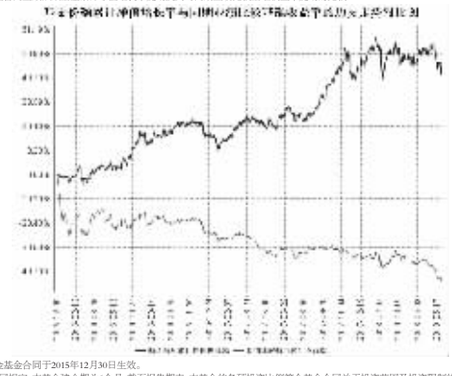
3、所列数据截止到报告期最后一日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

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	-2.45%	1.25%	-13.27%	1.15%	10.82%	0.10%

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12月30日生效。

2、按基金合同规定，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；股票资产占基金资产的比例为80%－95%，其中投资于本基金界定的文体产业范围内股票不低于非现金资产的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，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

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		
黄芳	本基金的基金经理	2015年12月30日	-	11	曾在嘉实基金担任股票交易员；2011年加入工银瑞信，现任研究部大消费研究团队负责人、基金经理。2015年12月30日至今，担任工银瑞信文体产业股票型基金基金经理；2018年2月13日至今，担任工银瑞信新生代消费灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
林梦	本基金的基金经理	2017年10月24日	-	10	曾在中信证券股份有限公司担任高级经理，2011年加入工银瑞信基金管理有限公司，现任研究部餐饮旅游、商贸零售、纺织服装行业高级研究员、基金经理。2017年10月24日至今，担任工银瑞信文体产业股票型证券投资基金基金经理。
张玮丹	本基金的基金经理	2017年10月27日	-	6	2012年加入工银瑞信基金管理有限公司，现任研究部家电、轻工制造、教育、体育行业高级研究员、基金经理。2017年10月27日至今，担任工银瑞信文体产业股票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

二季度，国内经济数据稳中趋弱，但下行斜率平缓，显示经济韧性犹存，与经济基本面的平稳相对应的则是内外部环境不确定性的增加，外部贸易摩擦的加剧使得我国外需前景趋弱，经常账户顺差存在一定程度压力，这一压力在汇率层面也有反映，内部信用风险的上升则使得企业违约数量有所增加，资本市场风险偏好受到抑制，政策层面，中央政治局4月23日会议提出要推动信贷、股市、债市、汇市、楼市健康发展，凸显决策层防控金融风险的决心和态度。

债券方面，收益率继续大幅下行，1年期国债到期收益率由一季度末的3.32%下行至二季度末的3.05%，10年期国债到期收益率由一季度末的3.74%下行至二季度末的3.50%，延续了一季度的上涨势头，但结构分化明显，受信用风险上升和违约担忧增加的影响，利率债表现明显好于信用债，低等级信用债不涨反跌，3年AA-信用债到期到收益率由一季度末的6.47%上行至二季度末的7.04%。股票方面，受风险偏好大幅下降的影响，A股市场普遍下跌，可转债方面，由于股票市场和低等级信用债有所下跌，整体转债类资产也明显下跌。

报告期内本基金根据宏观经济和通胀形势的变化，降低了久期和杠杆水平，继续保持较高的权益仓位。

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-2.45%，业绩比较基准收益率为-13.27%。

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	363,865,119.08	78.06
	其中：股票	363,865,119.08	78.06
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	20,000,000.00	4.29
	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	81,409,889.52	17.46
8	其他资产	890,006.72	0.19
9	合计	466,165,015.32	100.00

注：由于四舍五入的原因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	-	-
C	制造业	257,669,441.60	58.96
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	18,313,372.61	4.19
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	26,687,631.76	6.11
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	10,627,286.22	2.43
J	金融业	2,841,020.00	0.65
K	房地产业	23,957,075.00	5.48
L	租赁和商务服务业	14,967,215.75	3.42
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	81,226.14	0.02
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	8,720,850.00	2.00
S	综合	-	-
	合计	363,865,119.08	83.26

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	000651	格力电器	480,596	22,660,101.40	5.19
2	600271	航天信息	871,574	22,024,674.98	5.04
3	600887	伊利股份	537,966	15,009,251.40	3.43
4	300567	精测电子	165,847	13,201,421.20	3.02
5	600519	贵州茅台	17,793	13,014,867.78	2.98
6	600298	安琪酵母	351,060	12,525,820.80	2.87
7	600885	宏发股份	399,160	11,942,867.20	2.73
8	000895	双汇发展	431,243	11,389,127.63	2.61
9	600011	华能国际	1,741,641	11,076,836.76	2.53
10	300373	扬杰科技	368,100	10,527,660.00	2.41

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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	331,413.92
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	36,891.23
5	应收申购款	521,791.57
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	890,006.72

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处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

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	200,619,264.17
报告期期间基金总申购份额	121,273,062.09
减：报告期期间基金总赎回份额	24,723,849.30
报告期期间基金份额分类变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	297,168,476.96

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	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	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	持有份额	份额占比
机构	1	20180613-20180630	17,854,116.94	42,160,235.09	0.00	60,014,352.03	20.20%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品持有风险							
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文体产业股票型证券投资基金募集申请的注册文件；

2、《工银瑞信文体产业股票型证券投资基金基金合同》；

3、《工银瑞信文体产业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

2018 第二季度 报告

2018年6月30日

基金管理人：工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人：中国民生银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一八年七月二十日

§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7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2018年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	工银添颐债券
交易代码	485114
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	417,591,399.46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，为投资者提供务实投资的工具。
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平均收益，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	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	485114 / 485014
报告期末下属分级基金的份额总额	135,124,580.47份 / 282,466,818.99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（2018年4月1日 - 2018年6月30日）	
	工银添颐债券A	工银添颐债券B
1.本期已实现收益	699,639.19	647,765.84
2.本期利润	-8,634,444.37	-18,157,543.94
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0596	-0.0610
4.期末基金资产净值	260,824,662.18	520,037,969.40
5.期末基金份额净值	1.930	1.841

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