

工银瑞信信用纯债一年定期开放债券型证券投资基金

2018 第二季度 报告

018年6月30日

3、 特殊交易行为的说明

基本报告期内未出现异常交易的情况。基本报告期内，本公司所有投资资金参与的交易所公开竞价同日买卖成交较多或较多的单一证券占该证券当日成交量5%。

4、 报告期间资金投资和持仓分析

报告期内，本基金投资策略执行情况良好，主要源于以下：本表披露前，报告期内，美联储6月加息如达25bp，受美国经济健康复苏影响，美元指数自2019年4月以来持续上升，带动人民币升值，中美贸易紧张局势趋缓，对全球资本市场风险偏好形成阶段性提升，上证指数于报告期内企稳回升；我国外贸出口受到一定程度冲击，下半年景气度下降，国内股市行情波动较大，基金投资组合资产净值较年初有所回落，美联储在上半年已产生工作预期，为经济提供一定流动性，但考虑到二季度美国通胀数据超预期，已引发美元走强并融资收紧，使得全球市场下行，大宗商品下跌，二季度以来，三季度行情有所好转，公开市场流动性加大，资金面整体宽松，市场预期改善，港股交投活跃，恒生指数有所回升。

况下，部分理财产品面临在信用风险加剧而致减值。

4. 报告期内，公司理财产品以保本型产品为主，主要持仓为低风险理财产品，其中低风险理财产品占比为 90%。截至报告期末，公司持有的理财产品中，低风险理财产品占比为 90%，中高风险理财产品占比为 10%。

5. 报告期内公司的业绩表现

报告期内，工银理财前一年度开立保本型产品净值增长率为 1.81%，工银信託前一年度开立保本型产品净值增长率为 1.69%，业绩比较基准为人民币定期存款利率。

6. 报告期内公司持有人或多数资产净值出现亏损时

本基金在报告期内没有触发《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。

§ 投资组合情况

1. 报告期基金资产配置组合情况

	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益	-	-
3	货币资金投资	833,431,198.22	93.11
4	现金、债券	833,431,198.22	93.11
	资产支持证券	-	-
4	黄金类投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：应收融资融券 A 类融券保证金	-	-

8	其他资产	45,186,857.62	5.05
9	合计	895,128,327.49	100.00

注：由于四舍五入的原因金额占基金总资产的比例分母之和与合计可能有尾差。



报告期基金总申购份额	2,285,250.82	69,174,878.26
报告期基金总赎回份额	350,186,068.47	27,696,947.20
报告期基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-	-
报告期末基金份额总额	310,776,754.81	109,290,110.66

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。

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况									
式 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细									
8 报告期内，投资者持有基金份额总额及期间内持有人变动情况									
8.1 报告期内，投资者持有基金份额总额及期间内持有人变动情况									
8.2 报告期内持有基金份额变动情况									
序	持有基金份额变动期间及增减情况	期初	期间	期末	期初	期末	持有份额	持有占比	
号	1,200,000.00 份								
1	20100401-20100630	155,399,376.00	0.00%	0.00%	155,399,376.00	36.96%			
2	20100523-20100523	124,474,198.66	0.00%	0.00%	124,474,198.66	0.00%			
3	20100501-20100531	155,526,217.73	0.00%	0.00%	155,526,217.73	0.00%			

无。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

9.5 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会核准上海瑞福信信用评级一年期附条件开放债券型证券投资基金设立的文件；

2、《上海瑞福信信用评级一年期附条件开放债券型证券投资基金基金合同》；

3、《上海瑞福信信用评级一年期附条件开放债券型证券投资基金托管协议》；

4、基金管理人、业务委托人和托管人协议；

5、基金管理人、业务委托人和托管人决议；

6、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告；

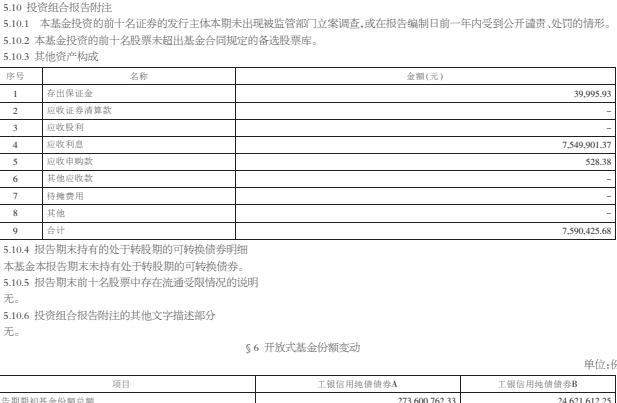
7、存底

基金管理人或基金托管人的住所；

8、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，在营业时间取得上述文件的复印件。

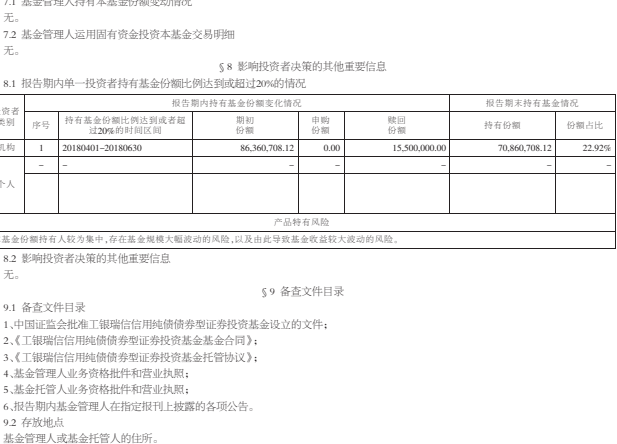
2018 第二季度 报告



报告期期末基金总申购份额	101,089,117.24	94.00%
报告期期末基金总赎回份额	107,777,767.54	25,412,488.13
报告期期末基金份额变动份额(份额减少以“-”填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	267,492,712.33	41,613,642.70

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。

e. 基金管理人 2019 年度应支付给基金托管人的费用



5	170311	170311	200,000	20,034,000.00	5.56
---	--------	--------	---------	---------------	------