

## 工银瑞信7天理财债券型证券投资基金

## 2013第四季度报告

2013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:二〇一四年一月二十二日

## §1 重要提示

基金管理人的董事局及董事会对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2014年1月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等，并保证不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

基金合同约定的基金投资人适用费用的收取情况和相关基金资产，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。投资人认购、申购或赎回本基金前请仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期自2013年10月1日起至12月31日止。

## §2 基本产品概况

基金简称	工银7天理财债券
交易代码	485118
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年6月22日
报告期末基金份额总额	24,075,929,511.00份
在基金定期报告披露前不赎回的基金资产	在基金定期报告披露前不赎回的基金资产的基础上，力争实现超过业绩比较基准的投资收益。
投资目标	将本基金的预期风险、预期收益控制在可接受的范围内，力争实现超过业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金将根据宏观经济、信用环境、相对价值策略等投资策略，在严格控制风险的前提下，积极稳定、合理的配置组合。
业绩比较基准	人民币活期存款利率(税后) + 0.4%
风险收益特征	本基金为货币市场基金，风险较低，预期收益、风险低于股票基金、混合型基金、债券型基金，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7天理财债券 A 工银7天理财债券 B
下属分级基金的交易代码	485118 485018
报告期末下属分级基金的份额总额	18,965,346,419.45份 5,442,583,332.34份

## §3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标	报告期(2013年10月1日-2013年12月31日)	报告期(2013年10月1日-2013年12月31日)	报告期(2013年10月1日-2013年12月31日)
1.本期已实现收益	308,745,137.46	126,099,743.56	126,099,743.56
2.本期利润	308,745,137.46	126,099,743.56	126,099,743.56
3.期末基金资产净值	18,965,346,419.45	5,442,583,332.34	5,442,583,332.34

注:1)本基金收益分配是按日结转份额。

2)上表所列数据截至2013年12月31日。

3)本期利润指基金利润与前期利润的和，其中本期利润不包含利润的已实现部分。

4)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差额即为货币市场基金的利息收入。

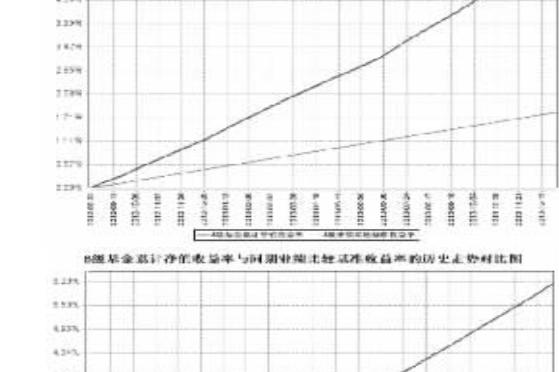
5)基金净值是指基金资产总值除以基金资产净值的40%。

6)报告期未按合同约定计算的份额限制比例

序号	平均申购期限	各期限占基金资产净值的比例 (%)	各期限占基金资产净值的比例 (%)
1	30天以内	29.84	11.75
2	30天(含)-90天	-	-
3	90天(含)-90天	6.65	-
4	90天(含)-180天	-	-
5	180天(含)-399天(含)	23.54	-
6	399天以上	-	-
7	合计	107.30	11.75

注:本基金收益分配是按日结转份额。

3.2.2 本期期间内各期限占基金资产净值比例变化情况



注:上表中,债券的净资产包括债券面值和应计利息。

5.5 报告期按申购金额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(份)	占基金资产净值比例(%)
1	130214	13国开14	12,500,000	1.24%
2	090407	09国债07	3,500,000	0.36%
3	130236	13国债36	3,300,000	0.33%
4	04135807	13国开2001	3,200,000	0.32%
5	04135304	13国开2002	2,500,000	0.24%
6	04135205	13国开2002	2,400,000	0.23%
7	04135501	13国开2002	2,000,000	0.20%
8	04135601	13国开2002	2,000,000	0.19%
9	04135406	13国债200	2,000,000	0.19%
10	04135700	13国债200	1,900,000	0.18%

注:上表中,债券的净资产包括债券面值和应计利息。

5.6 剩余期限超过99天的浮动利率债券

序号	债券代码	债券名称	债券数量(份)	占基金资产净值比例(%)
1	130214	13国开14	12,500,000	1.24%

注:上表中,债券的净资产包括债券面值和应计利息。

5.7 剩余期限超过99天的浮动利率债券

序号	债券代码	债券名称	债券数量(份)	占基金资产净值比例(%)
1	130214	13国开14	12,500,000	1.24%

注:上表中,债券的净资产包括债券面值和应计利息。

5.8 本期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	资产支持证券代码	资产支持证券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	130214	13国开14	12,500,000	1.24%
2	090407	09国债07	3,500,000	0.36%
3	130236	13国债36	3,300,000	0.33%
4	04135807	13国开2001	3,200,000	0.32%
5	04135304	13国开2002	2,500,000	0.24%
6	04135205	13国开2002	2,400,000	0.23%
7	04135501	13国开2002	2,000,000	0.20%
8	04135601	13国债200	2,000,000	0.19%
9	04135406	13国债200	2,000,000	0.19%
10	04135700	13国债200	1,900,000	0.18%

注:上表中,债券的净资产包括债券面值和应计利息。

5.9 剩余期限超过99天的浮动利率债券

序号	债券代码	债券名称	债券数量(份)	占基金资产净值比例(%)
1	130214	13国开14	12,500,000	1.24%

注:上表中,债券的净资产包括债券面值和应计利息。

5.10 本期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

序号	权证代码	权证名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	130214	13国开14	12,500,000	1.24%

注:上表中,债券的净资产包括债券面值和应计利息。

5.11 本期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	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600036	招商银行	12,500,000	1.24%

注:上表中,债券的净资产包括债券面值和应计利息。

5.12 本期按公允价值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	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	130214	13国开		