

工银瑞信安盈货币市场基金 2016 年第 2 季度报告

2016 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：二〇一六年七月二十日

§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 2016 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 2016 年 4 月 26 日（基金合同生效日）起至 6 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	工银安盈货币	
交易代码	002679	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 4 月 26 日	
报告期末基金份额总额	5,200,021,255.06 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型基金，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	中国民生银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	工银安盈货币 A	工银安盈货币 B
下属分级基金的交易代码	002679	002680
报告期末下属分级基金的份额总额	21,255.06 份	5,200,000,000.00 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（2016年4月26日—2016年6月30日）	
	工银安盈货币 A	工银安盈货币 B
1. 本期已实现收益	80.49	16,754,762.19
2. 本期利润	80.49	16,754,762.19
3. 期末基金资产净值	21,255.06	5,200,000,000.00

注：（1）本基金收益分配是现金分红，每日分配、按季支付。

（2）所列数据截止到 2016 年 6 月 30 日。

（3）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。

（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金额相等。

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

工银安盈货币 A

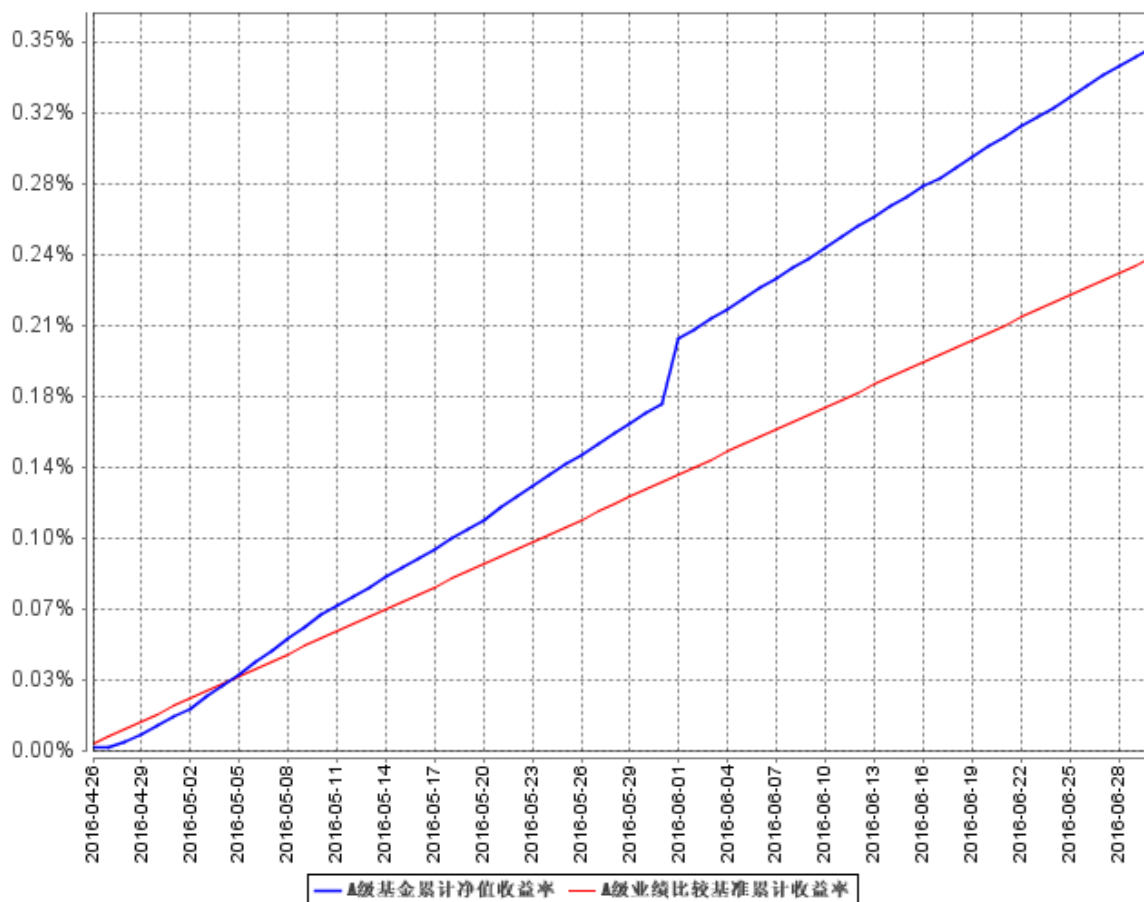
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.3468%	0.0034%	0.2434%	0.0000%	0.1034%	0.0034%

工银安盈货币 B

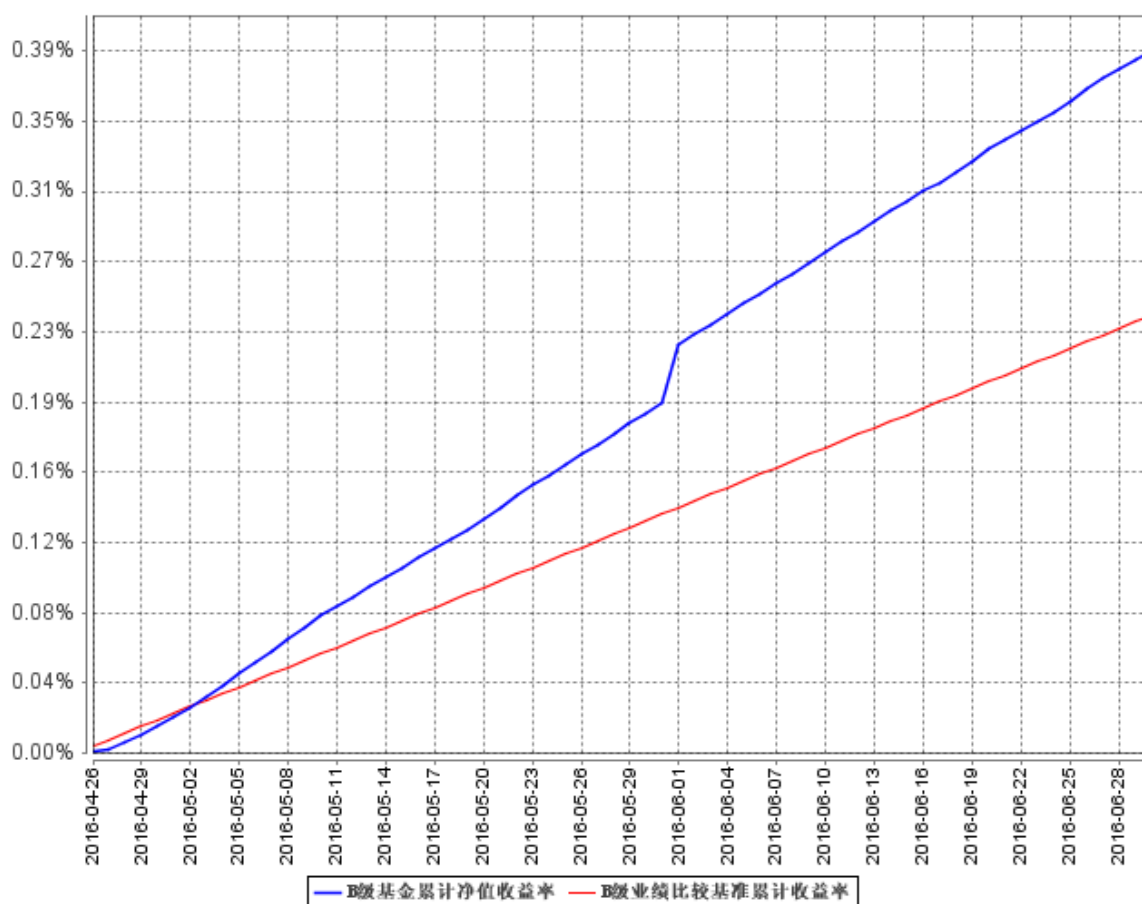
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.3901%	0.0034%	0.2434%	0.0000%	0.1467%	0.0034%

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

A级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



B级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2016 年 4 月 26 日生效。截至报告期末，本基金尚处于建仓期。

2、按基金合同规定，本基金建仓期为 6 个月。建仓期满，本基金的各项投资比例应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		
谷衡	固定收益部副总监，本基金的基金经理	2016 年 4 月 26 日	-	11	先后在华夏银行总行担任交易员，在中信银行总行担任交易员；2012 年加入工银瑞信，现任固定收益部副总监；2012 年 11 月 13 日至今，担任工银瑞信 14 天理财债券型

					<p>发起式证券投资基金； 2013 年 1 月 28 日至今，担任工银瑞信 60 天理财债券型基金基金经理；2013 年 3 月 28 日至 2015 年 1 月 19 日，担任工银安心场内实时申赎货币基金基金经理；2014 年 9 月 30 日至今，担任工银瑞信货币市场基金基金经理；2015 年 7 月 10 日至今，担任工银瑞信财富快线货币市场基金基金经理；2015 年 12 月 14 日至今，担任工银瑞信添福债券基金基金经理；2016 年 4 月 26 日至今，担任工银瑞信安盈货币市场基金基金经理。</p>
--	--	--	--	--	--

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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 5 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

二季度经济在地产脉冲结束和广义信用出现大幅度收缩后重现疲态，投资端中民间投资增速下降较大，制造业投资也在实体回报率下降情况下继续下行，同时在地产销量增速回落情况下，地产拐点即将出现，经济在三季度可能仍然持续弱势。整体来看货币政策如季度执行报告所述处于松紧适度的稳健态度，短端基准利率自去年 10 月 23 日降息后也未继续下调，二季度货币市场资产收益在四月底伴随资金市场波动出现较大幅度上行后，五六月份随着资金面平稳收益率逐渐下降，至二季度末，7 天回购利率下降 13bp 至 2.72%，一年期 AAA 短融收益率上升 11bp 至 2.96%，一年期国开金融债收益率上升 19bp 至 2.60%。

二季度，本基金通过对客户需求以及宏观经济和货币市场的判断，积极应对客户在月末和季末的流动性要求，合理安排组合的现金流，并在确保流动性的前提下，通过对存款和债券配置的时点安排，增厚组合收益率。同时，在实体经济产能去化压力较大的情况下，本基金一直严控债券配置的信用资质。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内，工银安盈货币 A 份额净值增长率为 0.3468%，工银安盈货币 B 份额净值增长率为 0.3901%，业绩比较基准收益率为 0.2434%。

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	固定收益投资	1,623,029,254.79	26.03
	其中：债券	1,623,029,254.79	26.03
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	400,000,800.00	6.41

	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	4,156,995,726.16	66.66
4	其他资产	55,855,219.06	0.90
5	合计	6,235,881,000.01	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 报告期债券回购融资情况

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	9.94	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	1,031,800,000.00	19.84
	其中：买断式回购融资	-	-

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	63
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	120
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	63

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

投资组合平均剩余期限没有超过 120 天的情况

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	31.56	19.84
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)-60 天	57.73	-

	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)-90 天	13.65	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)-180 天	12.19	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	180 天(含)-397 天(含)	3.71	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	118.85	19.84

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	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	269,756,507.07	5.19
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	1,253,337,963.37	24.10
5	企业短期融资券	99,934,784.35	1.92
6	中期票据	-	-
7	同业存单	-	-
8	其他	-	-
9	合计	1,623,029,254.79	31.21
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。

5.5 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	122266	13 中信 03	4,040,000	406,077,080.91	7.81
2	122280	13 海通 01	3,550,000	360,707,921.74	6.94
3	122286	13 中信建	2,000,000	203,211,216.50	3.91
4	122149	12 石化 01	1,600,000	163,214,657.66	3.14
5	122079	11 上港 02	1,200,000	120,127,086.56	2.31
6	020114	16 贴债 16	1,000,000	99,903,070.17	1.92
7	019520	15 国债 20	900,000	90,007,281.38	1.73
8	020117	16 贴债 19	800,000	79,846,155.52	1.54
9	011699894	16 港中旅 SCP001	700,000	69,973,947.49	1.35

10	011699897	16 中电投 SCP007	300,000	29,960,836.86	0.58
----	-----------	------------------	---------	---------------	------

注：上表中，债券的成本包括债券面值和折溢价。

5.6 “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	-
报告期内偏离度的最高值	0.0000%
报告期内偏离度的最低值	-0.1395%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0826%

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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 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。

5.8.2 本报告期内，本基金持有的剩余期限小于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券的摊余成本总计在每个交易日均未超过日基金资产净值 20%。

5.8.3 基金投资前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的投资决策程序说明：

根据 13 海通 01 的发行主体海通证券 2015 年 9 月 11 日发布的公告，因公司涉嫌未按规定审查、了解客户真实身份违法违规案，收到中国证监会行政处罚事先告知书（处罚字【2015】73 号），中国证监会对此采取责令改正、给予警告的行政处罚。投资决策流程符合公司的制度要求，目前公司生产经营和财务状况保持稳定，对债券投资无影响。

5.8.4 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	172,662.83
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	55,682,556.23
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-

7	其他	-
8	合计	55,855,219.06

5.8.5 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	工银安盈货币 A	工银安盈货币 B
基金合同生效日（2016 年 4 月 26 日）基金 份额总额	30,130.69	200,000,000.00
报告期期初基金份额总额	-	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份 额	1,000.00	5,000,001,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份 额	9,875.63	1,000.00
报告期期末基金份额总额	21,255.06	5,200,000,000.00

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

本基金自基金合同生效日（2016 年 4 月 26 日）起至报告期期末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安盈货币市场基金募集申请的注册文件；
- 2、《工银瑞信安盈货币市场基金基金合同》；
- 3、《工银瑞信安盈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办公场所。

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。