

工银瑞信信用添利债券型证券投资基金 2016 年半年度报告

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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：二〇一六年八月二十六日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 8 月 19 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 其他指标.....	9
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	15
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	15
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
6.4 报表附注.....	19
§7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况.....	38
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	38
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	39
7.6 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.....	39
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	40
7.8 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贵金属投资明细.....	40
7.9 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.....	40
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	40
7.11 投资组合报告附注.....	40

§8 基金份额持有人信息	41
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	41
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	41
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	41
§9 开放式基金份额变动	42
§10 重大事件揭示	42
10.1 基金份额持有人大会决议.....	42
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	42
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	43
10.4 基金投资策略的改变.....	43
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	43
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	43
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	43
10.8 其他重大事件.....	44
§11 影响投资者决策的其他重要信息	46
§12 备查文件目录	46
12.1 备查文件目录.....	46
12.2 存放地点.....	46
12.3 查阅方式.....	46

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	工银瑞信信用添利债券型证券投资基金	
基金简称	工银添利债券	
基金主代码	485107	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2008 年 4 月 14 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	
报告期末基金份额总额	9,149,470,893.40 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	工银添利债券 A	工银添利债券 B
下属分级基金的交易代码:	485107	485007
报告期末下属分级基金的份额总额	4,368,285,264.84 份	4,781,185,628.56 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在控制风险与保持资产流动性的基础上，追求基金资产的长期稳定增值。
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	80%×中债企业债总指数+20%×中债国债总指数。
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于低风险基金产品，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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		工银瑞信基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	朱碧艳	田青
	联系电话	400-811-9999	010-67595096
	电子邮箱	customerservice@icbccs.com.cn	tianqing1.zh@ccb.cn
客户服务电话		400-811-9999	010-67595096
传真		010-66583158	010-66275853
注册地址		北京市西城区金融大街 5 号、甲 5 号 6 层甲 5 号 601、甲 5 号 7 层甲 5 号 701、甲 5 号 8 层甲 5 号 801、甲 5 号 9 层甲 5 号 901	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 A 座 6-9 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		100033	100033

法定代表人	郭特华	王洪章
-------	-----	-----

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、证券时报、上海证券报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.icbccs.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	工银瑞信基金管理有限公司	北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 A 座 6-9 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	工银添利债券 A	工银添利债券 B
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)	报告期(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	89,346,451.64	47,027,318.65
本期利润	32,614,964.83	49,799,634.79
加权平均基金份额本期利润	0.0087	0.0220
本期加权平均净值利润率	0.70%	1.78%
本期基金份额净值增长率	0.77%	0.54%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	239,690,883.77	246,274,024.68
期末可供分配基金份额利润	0.0549	0.0515
期末基金资产净值	5,407,241,876.34	5,897,774,913.68
期末基金份额净值	1.2378	1.2335
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	97.82%	91.46%

注：1. 所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. 本基金基金合同生效日为 2008 年 4 月 14 日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

工银添利债券 A

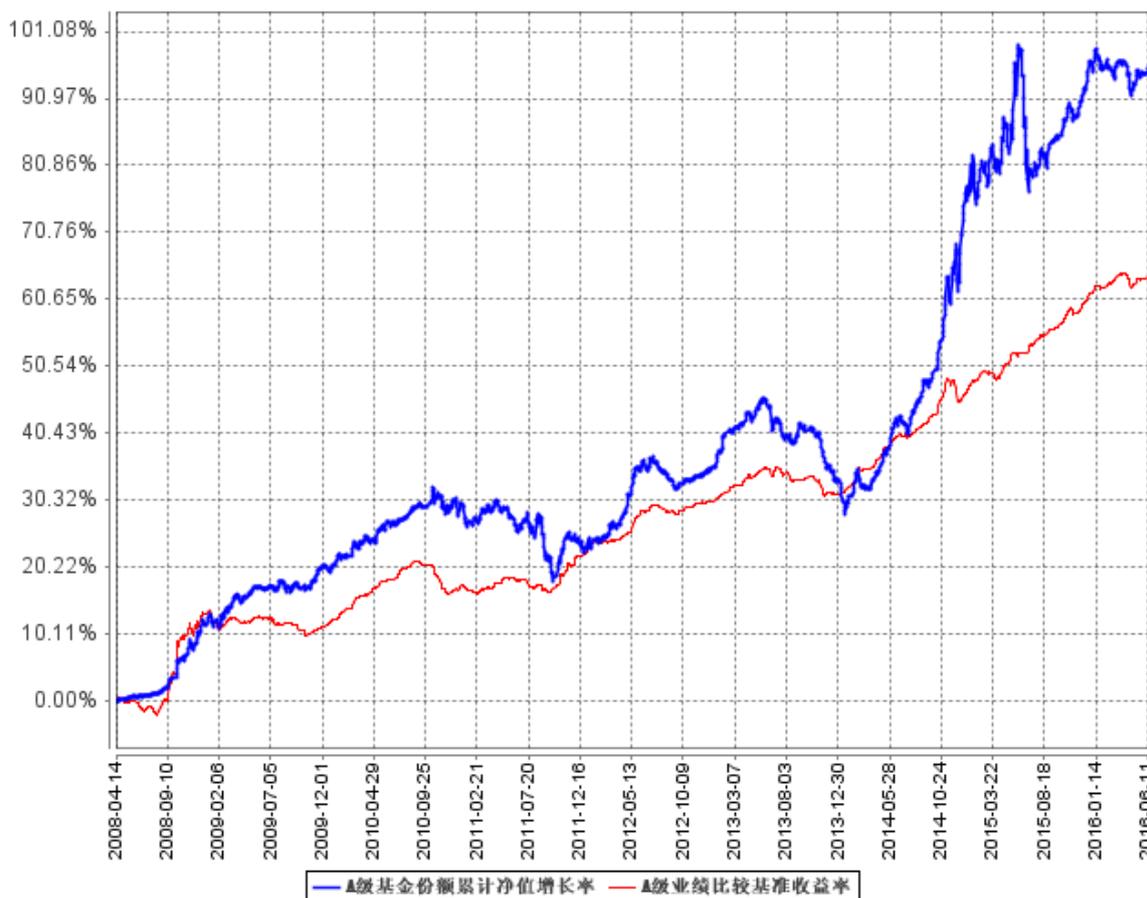
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.63%	0.11%	0.76%	0.04%	0.87%	0.07%
过去三个月	0.63%	0.20%	0.32%	0.08%	0.31%	0.12%
过去六个月	0.77%	0.22%	2.05%	0.07%	-1.28%	0.15%
过去一年	8.01%	0.28%	8.08%	0.07%	-0.07%	0.21%
过去三年	39.15%	0.48%	22.45%	0.10%	16.70%	0.38%
自基金合同生效起至今	97.82%	0.36%	64.98%	0.13%	32.84%	0.23%

工银添利债券 B

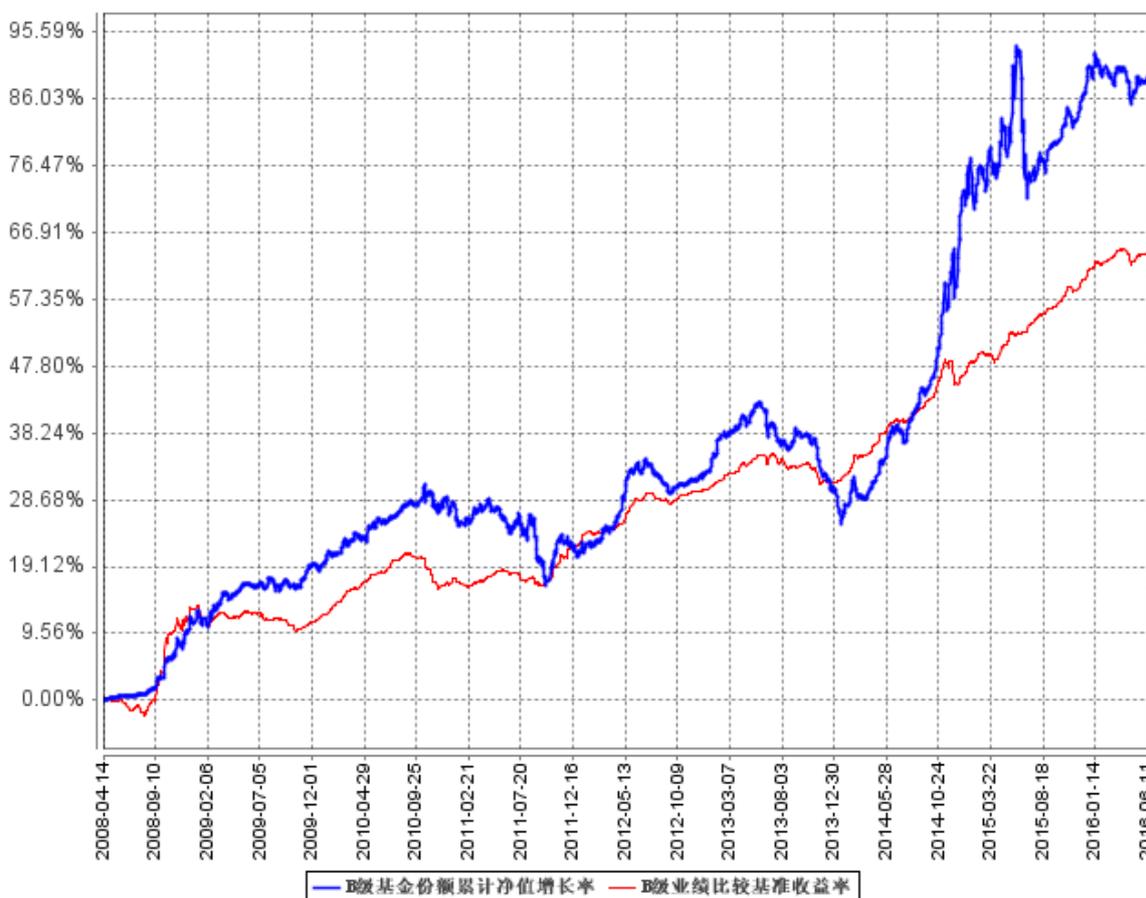
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.60%	0.10%	0.76%	0.04%	0.84%	0.06%
过去三个月	0.53%	0.20%	0.32%	0.08%	0.21%	0.12%
过去六个月	0.54%	0.22%	2.05%	0.07%	-1.51%	0.15%
过去一年	7.53%	0.28%	8.08%	0.07%	-0.55%	0.21%
过去三年	37.58%	0.48%	22.45%	0.10%	15.13%	0.38%
自基金合同生效起至今	91.46%	0.36%	64.98%	0.13%	26.48%	0.23%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



B级基金份额累计净值增长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 2008 年 4 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：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%，本基金持有的公司债券、企业债券、金融债、短期融资券、资产支持证券等除国债、央行票据以外的固定收益类资产投资比例不低于债券类资产的 80%，投资于股票等权益类证券的比例不超过基金资产的 20%，且必须在权益类资产上市交易或流通受限解除后不超过 3 个月的时间内卖出，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%。

3.3 其他指标

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为工银瑞信基金管理有限公司，成立于 2005 年 6 月 21 日，是我国第一家由银行直接发起设立并控股的合资基金管理公司，注册资本为 2 亿元人民币，注册地在北京。公司目前拥有共同基金募集和管理资格、境外证券投资管理业务资格、企业年金基金投资管理人资格、特定客户资产管理业务资格、全国社保基金境内投资管理人资格。

截至 2016 年 6 月 30 日，公司旗下管理 83 只公募基金——工银瑞信核心价值混合型证券投资基金、工银瑞信货币市场基金、工银瑞信精选平衡混合型证券投资基金、工银瑞信稳健成长混合型证券投资基金、工银瑞信增强收益债券型证券投资基金、工银瑞信红利混合型证券投资基金、工银瑞信中国机会全球配置股票证券投资基金、工银瑞信信用添利债券型证券投资基金、工银瑞信大盘蓝筹混合型证券投资基金、工银瑞信沪深 300 指数证券投资基金、上证中央企业 50 交易型开放式指数证券投资基金、工银瑞信中小盘成长混合型证券投资基金、工银瑞信全球精选股票型证券投资基金、工银瑞信双利债券型证券投资基金、深证红利交易型开放式指数证券投资基金、工银瑞信深证红利 ETF 联接基金、工银瑞信四季收益债券型证券投资基金、工银瑞信消费服务行业混合型证券投资基金、工银瑞信添颐债券型证券投资基金、工银瑞信主题策略混合型证券投资基金、工银瑞信保本混合型证券投资基金、工银瑞信睿智中证 500 指数分级证券投资基金、工银瑞信基本面量化策略混合型证券投资基金、工银瑞信纯债定期开放债券型证券投资基金、工银瑞信 7 天理财债券型证券投资基金、工银瑞信睿智深证 100 指数分级证券投资基金、工银瑞信 14 天理财债券型发起式证券投资基金、工银瑞信信用纯债债券型证券投资基金、工银瑞信 60 天理财债券型证券投资基金、工银瑞信优质精选混合型证券投资基金、工银瑞信增利债券型证券投资基金、工银瑞信产业债债券型证券投资基金、工银瑞信信用纯债一年定期开放债券型证券投资基金、工银瑞信信用纯债两年定期开放债券型证券投资基金、工银瑞信标普全球自然资源指数证券投资基金、工银瑞信保本 3 号混合型证券投资基金、工银瑞信月月薪定期支付债券型证券投资基金、工银瑞信金融地产行业混合型证券投资基金、工银瑞信双债增强债券型证券投资基金、工银瑞信添福债券型证券投资基金、工银瑞信信息产业混合型证券投资基金、工银瑞信薪金货币市场基金、工银瑞信纯债债券型证券投资基金、工银瑞信绝对收益策略混合型发起式证券投资基金、工银瑞信目标收益一年定期开放债券型投资基金、工银瑞信新财富灵活配置混合型证券投资基金、工银瑞信现金快线货币市场基金、工银瑞信添益快线货币市场基金、工银瑞信高端制造行业股票型证券投

资基金、工银瑞信研究精选股票型证券投资基金、工银瑞信医疗保健行业股票型证券投资基金、工银瑞信创新动力股票型证券投资基金、工银瑞信国企改革主题股票型证券投资基金、工银瑞信战略转型主题股票型证券投资基金、工银瑞信新金融股票型证券投资基金、工银瑞信美丽城镇主题股票型证券投资基金、工银瑞信总回报灵活配置混合型证券投资基金、工银瑞信新材料新能源行业股票型证券投资基金、工银瑞信养老产业股票型证券投资基金、工银瑞信丰盈回报灵活配置混合型证券投资基金、工银瑞信中证传媒指数分级证券投资基金、工银瑞信农业产业股票型证券投资基金、工银瑞信生态环境行业股票型证券投资基金、工银瑞信互联网加股票型证券投资基金、工银瑞信财富快线货币市场基金、工银瑞信聚焦 30 股票型证券投资基金、工银瑞信中证新能源指数分级证券投资基金、工银瑞信中证环保产业指数分级证券投资基金、工银瑞信中证高铁产业指数分级证券投资基金、工银瑞信新蓝筹股票型证券投资基金、工银瑞信丰收回报灵活配置混合型证券投资基金、工银瑞信中高等级信用债债券型证券投资基金、工银瑞信新趋势灵活配置混合型证券投资基金、工银瑞信文体产业股票型证券投资基金、工银瑞信物流产业股票型证券投资基金、工银瑞信前沿医疗股票型证券投资基金、工银瑞信国家战略主题股票型证券投资基金、工银瑞信香港中小盘股票型证券投资基金、工银瑞信沪港深股票型证券投资基金、工银瑞信瑞丰纯债半年定期开放债券型证券投资基金、工银瑞信泰享三年理财债券型证券投资基金、工银瑞信安盈货币市场基金、工银瑞信恒享纯债债券型证券投资基金，证券投资基金管理规模逾 4800 亿元人民币。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
江明波	副总经理，本基金的基金经理	2008 年 4 月 14 日	-	16	曾任鹏华基金普天债券基金经理、固定收益负责人；2004 年 6 月至 2006 年 12 月，担任全国社保基金二零四组合和二零四组合基金经理；2006 年加入工银瑞信，现任副总经理，兼任工银瑞信资产管理（国际）有限公司固定收益投资总监、工银瑞信投资管理有限公司董事；2011 年起担任全国社保组合基金经理；2008 年 4 月 14 日至今，担任工银添利基金基金经理；2011 年 2 月 10 日至今，担任工银四季收

					益债券型基金基金经理；2013年3月6日至今，担任工银瑞信增利分级债券基金（自2016年3月8日起，变更为工银瑞信增利债券型证券投资基金（LOF））基金经理。
--	--	--	--	--	---

注：

- 1、任职日期说明：江明波的任职日期为基金合同生效日期
- 2、离任日期说明：无
- 3、证券从业年限的计算标准：证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定等
- 4、本基金无基金经理助理

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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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，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；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9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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年债券市场大幅波动，总体仍维持在牛市格局当中。10 年金融债先下后上再下，一月份先是受到汇率贬值、股票市场大幅下跌等的影响，收益率快速下行，10 年国开债向下突破 3.0%，收益率均到达上半年最低点，而后受到天量信贷投放的信息的刺激，收益率大幅反弹，并在 4 月份短短两周内大幅上行超过 30BP，到达上半年最高点，5、6 月份则大幅下行超过 40BP，10 年国债收益率变化幅度要小很多，以 2.9%为中轴上下波动，最低到 2.7%，最高到 3.0%，短端利率水平继续保持稳定，信用利差则有所放大。

二季度收益率的大幅波动主要来自于央企违约所带来的流动性冲击，4 月 11 日，中铁物资公告 168 亿债务融资工具集体暂停交易，导致市场风险偏好急剧降低，机构纷纷赎回债券基金，为了应对赎回压力，基金被迫减持流动性好的利率债，导致中长期金融债在短短的两周内收益率上升超过 30BP，出现了自钱荒以来所罕见的流动性冲击。但债券基本面没有任何的恶化，甚至于还出现了有利的变化，在新增资金的涌入下，收益率迅速见顶并且缓慢回落，并在基本面数据的支持下，6 月份收益率出现了快速回落。

本基金在上半年继续拉长久期，增持中长期利率债，减持中低等级信用债，维持较高杠杆水平。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，工银添利债券 A 份额净值增长率为 0.77%，工银添利债券 B 份额净值增长率为 0.54%，业绩比较基准收益率为 2.05%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，债券牛市没有结束，经济增长和通货膨胀以及货币政策将进一步支持债券牛市。从全球范围看，经济仍在缓慢复苏当中，美国的复苏也非常脆弱，6 月底的英国脱欧事件将继续发酵并对全球经济增长带来更大不确定性。中国今年以来的经济的企稳靠的就是基建和房地产投资，民间投资出现了近十年来最大的萎缩，而在房地产大周期见顶的背景下，短期的销售好转也即将见顶，尤其在销售增速大幅高于长期趋势的情况下，未来房地产销售增速面临极大的下行压力，一旦房地产销售转差，而制造业投资没有起色的情况下，单独靠基建投资显然无法支撑经济的下行，未来经济面临更大的下行压力。而以 CPI 为代表的通胀水平，在食品涨幅减缓的情况下，面临的压力将越来越小。为了抑制整体社会加杠杆的冲动，央行一直将短端利率水平维持

在一个相对于经济增长和通胀更高的水平上，即使维持中性的货币政策，未来这一短端利率水平也必将随着经济增长和通胀的回落而进一步下行，债券市场有望迎来政策利率主动下调所带来的债券牛市下半场。在类属配置方面，利率债券是当前较有价值的品种，原因在于随着经济的进一步下行，信用违约事件更加频发，目前的信用利差已经接近历史最低水平，无法充分补偿利率风险，而中国的利率债券水平远高于世界上主要国家的水平，未来仍有很大的下行空间。

本基金将继续持有中长期利率债，保持较长久期。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

4.6.1 参与估值流程各方及人员（或小组）的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历

4.6.1.1 职责分工

（1）参与估值小组成员为 4 人，分别是公司运作部负责人、研究部负责人、风险管理部负责人、法律合规部负责人，组长由运作部负责人担任。

（2）各部门负责人也可推荐代表各部门参与估值小组的成员，如需更换，由相应部门负责人提出。小组成员需经运作部主管副总批准同意。

4.6.1.2 专业胜任能力及相关工作经历

小组由具有多年从事估值运作、证券行业研究、风险管理及熟悉业内法律法规的专家型人员组成。

4.6.2 基金经理参与或决定估值的程度

本公司基金经理参与讨论估值原则及方法，但不参与最终估值决策。

4.6.3 参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4.6.4 已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度

尚无已签约的任何定价服务。本基金所采用的估值流程及估值结果均已经过会计师事务所鉴证，并经托管银行复核确认。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金利润分配情况如下：

本基金本期于 2016 年 1 月 12 日发布分红公告，A 类基金份额每 10 份派发红利 1.280 元，B 类基金份额每 10 份派发红利 1.270 元，两类基金份额共计派发红利 913,991,098.17 元，权益登记日为 2016 年 1 月 19 日。

本基金本报告期共计派发红利 913,991,098.17 元。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金实施利润分配的金额为 913,991,098.17 元。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：工银瑞信信用添利债券型证券投资基金

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	48,276,231.00	11,140,932.04
结算备付金		250,113,182.36	110,031,214.94
存出保证金		48,495.64	206,460.32
交易性金融资产	6.4.7.2	16,295,593,995.74	10,044,004,227.84
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-

债券投资		16,295,593,995.74	10,044,004,227.84
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	4,578,871.16
应收利息	6.4.7.5	324,172,429.53	190,456,738.57
应收股利		-	-
应收申购款		3,455,191.66	6,317,922.17
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		16,921,659,525.93	10,366,736,367.04
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		5,604,445,563.32	2,539,997,725.00
应付证券清算款		490,014.85	-
应付赎回款		905,265.76	11,292,113.48
应付管理人报酬		4,273,486.86	2,500,458.44
应付托管费		1,424,495.62	833,486.14
应付销售服务费		1,269,727.25	859,180.38
应付交易费用	6.4.7.7	83,789.21	81,164.40
应交税费		-	-
应付利息		997,475.35	445,205.56
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	2,752,917.69	2,852,343.42
负债合计		5,616,642,735.91	2,558,861,676.82
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	9,149,470,893.40	5,765,109,459.97
未分配利润	6.4.7.10	2,155,545,896.62	2,042,765,230.25
所有者权益合计		11,305,016,790.02	7,807,874,690.22
负债和所有者权益总计		16,921,659,525.93	10,366,736,367.04

注：1、本基金基金合同生效日为2008年4月14日。

2、报告截止日2016年6月30日，基金份额总额为9,149,470,893.40份，其中A类基金份额净值为人民币1.2378元，份额总额为4,368,285,264.84份；B类基金份额净值为人民币1.2335元，份额总额为4,781,185,628.56份。

6.2 利润表

会计主体：工银瑞信信用添利债券型证券投资基金

本报告期：2016年1月1日至2016年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016年1月1日至 2016年6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015 年6月30日
一、收入		172,918,534.16	113,648,176.54
1.利息收入		233,679,277.85	86,355,489.79
其中：存款利息收入	6.4.7.11	2,113,806.25	409,956.51
债券利息收入		231,565,471.60	85,945,533.28
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-10,193,486.07	143,047,724.44
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	30,109,792.47
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-10,193,486.07	111,981,754.30
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	-	956,177.67
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-53,959,170.67	-117,028,780.83
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	3,391,913.05	1,273,743.14
减：二、费用		90,503,934.54	46,899,129.64
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	22,230,653.75	5,910,743.51
2. 托管费	6.4.10.2.2	7,410,217.88	1,970,247.91
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	5,588,682.32	1,664,550.42
4. 交易费用	6.4.7.19	179,519.51	589,987.33
5. 利息支出		54,845,259.29	36,529,122.43
其中：卖出回购金融资产支出		54,845,259.29	36,529,122.43
6. 其他费用	6.4.7.20	249,601.79	234,478.04
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		82,414,599.62	66,749,046.90
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		82,414,599.62	66,749,046.90

注：本基金基金合同生效日为2008年4月14日。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：工银瑞信信用添利债券型证券投资基金

本报告期：2016年1月1日至2016年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	5,765,109,459.97	2,042,765,230.25	7,807,874,690.22
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	82,414,599.62	82,414,599.62
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	3,384,361,433.43	944,357,164.92	4,328,718,598.35
其中：1.基金申购款	9,018,061,592.90	2,272,570,083.88	11,290,631,676.78
2.基金赎回款	-5,633,700,159.47	-1,328,212,918.96	-6,961,913,078.43
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-913,991,098.17	-913,991,098.17
五、期末所有者权益 (基金净值)	9,149,470,893.40	2,155,545,896.62	11,305,016,790.02
项目	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	1,404,091,571.94	461,734,690.05	1,865,826,261.99
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	66,749,046.90	66,749,046.90
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	-61,954,056.79	9,604,426.29	-52,349,630.50
其中：1.基金申购款	1,311,052,036.30	456,960,493.08	1,768,012,529.38
2.基金赎回款	-1,373,006,093.09	-447,356,066.79	-1,820,362,159.88
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的	-	-182,723,545.23	-182,723,545.23

基金净值变动(净值减少以“-”号填列)			
五、期末所有者权益(基金净值)	1,342,137,515.15	355,364,618.01	1,697,502,133.16

注：本基金基金合同生效日为 2008 年 4 月 14 日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>郭特华</u>	<u>朱碧艳</u>	<u>朱辉毅</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

工银瑞信信用添利债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2008]第 238 号《关于核准工银瑞信信用添利债券型证券投资基金募集的批复》核准,由工银瑞信基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《工银瑞信信用添利债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 4,828,223,135.44 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2008)第 37 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《工银瑞信信用添利债券型证券投资基金基金合同》于 2008 年 4 月 14 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 4,829,064,718.29 份基金份额,其中认购资金利息折合 841,582.85 份基金份额。本基金的基金管理人为工银瑞信基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司(以下简称“中国建设银行”)。

根据《工银瑞信信用添利债券型证券投资基金基金合同》和《工银瑞信信用添利债券型证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案,本基金自募集期起根据认购、申购费用收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购基金时收取认购、申购费用的,称为 A 类基金份额;不收取认购、申购费用,而是在本类别基金资产中计提销售服务费的,称为 B 类基金份额。本基金 A 类、B 类两种收费模式并存,由于基金费用的不同,本基金 A 类基金份额和 B 类基金份额分别计算基金份额净值,计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。投资人可自由选择认购、申购的基金份额类别,两类基金份额之间不能相互转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《工银瑞信信用添利债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括公司债券、企业债券、

可转换债券、短期融资券、金融债、资产支持证券、国债、央行票据、债券回购、股票、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。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%，其中投资于公司债券、企业债券、金融债、短期融资券、资产支持证券等除国债、央行票据以外的固定收益类资产投资比例不低于债券类资产 80%；投资于股票等权益类证券的比例不高于基金资产的 20%，只通过投资首次发行股票、增发新股、可转换债券转股以及权证行权等方式获得股票，不直接从二级市场买入股票，且必须在权益类资产上市交易或流通受限解除后不超过 3 个月的时间内卖出；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%。本基金的业绩比较基准为 $80\% \times \text{中债企业债总指数} + 20\% \times \text{中债国债总指数}$ 。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《工银瑞信信用添利债券型证券投资基金基金合同》和中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年上半年的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无需要说明的差错更正事项。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[1998]55 号《关于证券投资基金税收问题的通知》[适用于

CEF]/财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》[适用于 OEF]、财税[2004]78 号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，于 2015 年 9 月 8 日前暂减按 25% 计入应纳税所得额，自 2015 年 9 月 8 日起，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
活期存款	48,276,231.00
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	48,276,231.00

注：本基金本报告期末投资于定期存款。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	3,053,444,241.82	29,582,753.92
	银行间市场	13,109,435,630.11	103,131,369.89
	合计	16,162,879,871.93	132,714,123.81
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	16,162,879,871.93	16,295,593,995.74	132,714,123.81

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产**6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

本基金本期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易，也无在买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应收活期存款利息	39,903.72
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	112,550.90
应收债券利息	324,019,953.11
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	21.80
合计	324,172,429.53

注：“其他”为应收结算保证金利息

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	83,789.21
合计	83,789.21

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,821.29
预提信息披露费	149,178.12
预提审计费	49,726.04
应交债券利息税	2,542,892.24
预提账户维护费	9,300.00
应缴债券利息税	-
合计	2,752,917.69

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

工银添利债券 A		
项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,997,282,631.29	2,997,282,631.29
本期申购	3,204,073,572.59	3,204,073,572.59
本期赎回(以“-”号填列)	-1,833,070,939.04	-1,833,070,939.04
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	4,368,285,264.84	4,368,285,264.84

金额单位：人民币元

工银添利债券 B

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	2,767,826,828.68	2,767,826,828.68
本期申购	5,813,988,020.31	5,813,988,020.31
本期赎回(以“-”号填列)	-3,800,629,220.43	-3,800,629,220.43
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	4,781,185,628.56	4,781,185,628.56

注：“本期申购”中包含红利再投、转换入份额及金额，“本期赎回”中包含转出份额及金额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

工银添利债券 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	478,314,496.19	587,307,610.52	1,065,622,106.71
本期利润	89,346,451.64	-56,731,486.81	32,614,964.83
本期基金份额交易产生的变动数	194,396,420.77	268,689,604.02	463,086,024.79
其中：基金申购款	282,175,323.33	596,733,616.69	878,908,940.02
基金赎回款	-87,778,902.56	-328,044,012.67	-415,822,915.23
本期已分配利润	-522,366,484.83	-	-522,366,484.83
本期末	239,690,883.77	799,265,727.73	1,038,956,611.50

单位：人民币元

工银添利债券 B			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	437,479,823.38	539,663,300.16	977,143,123.54
本期利润	47,027,318.65	2,772,316.14	49,799,634.79
本期基金份额交易产生的变动数	153,391,495.99	327,879,644.14	481,271,140.13
其中：基金申购款	363,932,004.04	1,029,729,139.82	1,393,661,143.86
基金赎回款	-210,540,508.05	-701,849,495.68	-912,390,003.73
本期已分配利润	-391,624,613.34	-	-391,624,613.34
本期末	246,274,024.68	870,315,260.44	1,116,589,285.12

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

活期存款利息收入	264,892.82
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	1,848,400.28
其他	513.15
合计	2,113,806.25

注：“其他”为结算保证金收入。

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金本报告期无买卖股票投资收益。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-10,193,486.07
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	-10,193,486.07

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	4,828,708,711.81
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	4,745,211,217.42
减：应收利息总额	93,690,980.46
买卖债券差价收入	-10,193,486.07

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期间无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益**6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

本基金本报告期间无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益**6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期无买卖权证差价收入。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无其他衍生工具投资收益。

6.4.7.16 股利收益

本基金本报告期间无股利收益。

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
1. 交易性金融资产	-53,959,170.67
——股票投资	-
——债券投资	-53,959,170.67
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-53,959,170.67

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
基金赎回费收入	2,904,502.68
基金转换费收入	487,410.37
合计	3,391,913.05

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	5,919.51
银行间市场交易费用	173,600.00
合计	179,519.51

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
审计费用	49,726.04
信息披露费	149,178.12
账户维护费	18,600.00
其他	200.00
银行费用	31,897.63
合计	249,601.79

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金并无须作披露的重大资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期，与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
工银瑞信基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司	基金管理人股东、基金销售机构

注：1、本报告期本基金关联方未发生变化。

2、以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	22,230,653.75	5,910,743.51
其中：支付销售机构的客户维护费	394,142.55	425,788.40

注：1. 在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 0.60% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.60\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

2. 基金管理费每日计提，按月支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	7,410,217.88	1,970,247.91

注：1. 在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

2. 基金托管费每日计提，按月支付。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	工银添利债券 A	工银添利债券 B	合计
工银瑞信基金管理有限公司	-	4,972,590.44	4,972,590.44
中国工商银行股份有限公司	-	372,314.77	372,314.77
中国建设银行股份有限公司	-	59,579.00	59,579.00

公司			
合计	-	5,404,484.21	5,404,484.21
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	工银添利债券 A	工银添利债券 B	合计
工银瑞信基金管理有限公司	-	1,022,774.42	1,022,774.42
中国工商银行股份有限公司	-	468,475.53	468,475.53
中国建设银行股份有限公司	-	62,731.04	62,731.04
合计	-	1,553,980.99	1,553,980.99

注：1. A 类基金份额不收取销售服务费，B 类基金份额的销售服务费年费率为 0.40%。本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务。

$$H = E \times 0.40\% / \text{当年天数}$$

H 为 B 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 B 类基金份额前一日基金资产净值

2. 基金销售服务费每日计提，按月支付。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2016年1月1日至2016年6月30日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国建设银行股份有限公司	50,053,063.39	-	-	-	2,040,000,000.00	420,071.23
上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国建设银行股份有限公司	-	-	-	-	905,000,000.00	726,942.45

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	
	工银添利债券 A	工银添利债券 B
基金合同生效日（2008 年 4 月 14 日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	30,008,600.00	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	30,008,600.00	-
期末持有的基金份额	-	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

注：本基金的管理人在本报告期内未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末与上年度末均未投资本基金。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	48,276,231.00	264,892.82	6,411,839.22	117,953.61

注：1、本报告期末余额仅为活期存款，利息收入（本期）仅为活期存款利息收入；

2、上年度可比期间报告期末余额仅为活期存款，利息收入（上年度可比期间）仅为活期存款利息收入；

3、本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期和上年度可比期间内均未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

工银添利债券 A

金额单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日		每 10 份 基金份额分红 数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2016 年 1 月 19 日	-	2016 年 1 月 19 日	1.280	330,709,032.27	191,657,452.56	522,366,484.83	
合计	-	-	-	1.280	330,709,032.27	191,657,452.56	522,366,484.83	

工银添利债券 B

金额单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日		每 10 份 基金份额分红 数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2016 年 1 月 19 日	-	2016 年 1 月 19 日	1.270	370,807,312.51	20,817,300.83	391,624,613.34	
合计	-	-	-	1.270	370,807,312.51	20,817,300.83	391,624,613.34	

6.4.12 期末（2016 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而与期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 2,994,445,563.32 元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期 日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
130231	13 国开 31	2016 年 7 月 5 日	105.47	7,900,000	833,213,000.00
150308	15 进出 08	2016 年 7 月 5 日	107.05	6,400,000	685,120,000.00

140222	14 国开 22	2016 年 7 月 6 日	111.76	9,000,000	1,005,840,000.00
150314	15 进出 14	2016 年 7 月 6 日	103.93	6,850,000	711,920,500.00
合计				30,150,000	3,236,093,500.00

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 6 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 2,610,000,000.00 元，于 2016 年 7 月 1 日到期。该类交易要求本基金在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为债券型证券投资基金，属于偏低风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。

公司实行全面、系统的风险管理，风险管理覆盖公司所有战略环节、业务环节和操作环节。同时制定了系统化的风险管理程序，对风险管理的整个流程进行评估和改进。公司构建了分工明确、相互协作、彼此牵制的风险管理组织结构，形成了由四大防线共同筑成的风险管理体系：第一道防线由各个业务部门构成，各业务部门总监作为风险责任人，负责制订本部门的作业流程以及风险控制措施；第二道监控防线由公司专属风险管理部门法律合规部和风险管理部构成，法律合规部负责对公司业务的法律合规风险进行监控管理，风险管理部负责对公司投资管理风险和运作风险进行监控管理；第三道防线是由公司经营管理层和风险管理委员会构成，公司管理层通过执行委员会下的风险管理委员会对风险状况进行全面监督并及时制定相应的对策和实施监控措施；在上述这三道风险监控防线中，公司督察长和监察稽核人员对风险控制措施和合规风险情况进行全面检查、监督，并视所发生问题情节轻重及时反馈给各部门经理、公司总经理、公司治理与风险控制委员会、董事会、监管机构。督察长独立于公司其他业务部门和公司管理层，对内部控制制度的执行情况实行严格检查和及时反馈，并独立报告；第四道监控防线由董事会和公司治理与风险控制委员会构成，公司治理与风险控制委员会通过督察长和监察稽核人员的工作，掌握整体风险状况并进行决策。公司治理与风险控制委员会负责检查公司业务的内控制度的实施情况，监督公司对相关法律法规和公司制度的执行。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去

估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国建设银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2016年6月30日
A-1	-
A-1 以下	-
未评级	10,004,000.00
合计	10,004,000.00

注：1、表中所列示的债券投资为短期融资券及超短期融资券，其中超短期融资券无信用评级。

2、上述评级均取自第三方评级机构的债项评级。

3、于 2015 年 12 月 31 日，本基金未持有按短期信用评级的债券投资。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
AAA	329,273,100.00	357,116,748.00
AAA 以下	315,770,720.34	596,761,818.24
未评级	-	-
合计	645,043,820.34	953,878,566.24

注：1、表中所列示的债券投资为除短期融资券以外的信用债券。

2、上述评级均取自第三方评级机构的债项评级。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。本基金所持大部分证券为剩余期限较短、信誉良好的国债、企业债及央行票据等，除在证券交易所的债券回购交易及返售交易，其余均在银行间同业市场交易，均能够及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016年6 月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	48,276,231.00	-	-	-	-	-	48,276,231.00
结算备付金	250,113,182.36	-	-	-	-	-	250,113,182.36
存出保证	48,495.64	-	-	-	-	-	48,495.64

金							
交易性金融资产		-149,985,000.00	460,771,625.00	307,420,070.74	15,377,417,300.00		-16,295,593,995.74
应收利息		-	-	-	-	324,172,429.53	324,172,429.53
应收申购款		-	-	-	-	3,455,191.66	3,455,191.66
资产总计	298,437,909.00	149,985,000.00	460,771,625.00	307,420,070.74	15,377,417,300.00	327,627,621.19	16,921,659,525.93
负债							
卖出回购金融资产款	5,604,445,563.32	-	-	-	-	-	5,604,445,563.32
应付证券清算款		-	-	-	-	490,014.85	490,014.85
应付赎回款		-	-	-	-	905,265.76	905,265.76
应付管理人报酬		-	-	-	-	4,273,486.86	4,273,486.86
应付托管费		-	-	-	-	1,424,495.62	1,424,495.62
应付销售服务费		-	-	-	-	1,269,727.25	1,269,727.25
应付交易费用		-	-	-	-	83,789.21	83,789.21
应付利息		-	-	-	-	997,475.35	997,475.35
其他负债		-	-	-	-	2,752,917.69	2,752,917.69
负债总计	5,604,445,563.32	-	-	-	-	12,197,172.59	5,616,642,735.91
利率敏感度缺口	-5,306,007,654.32	149,985,000.00	460,771,625.00	307,420,070.74	15,377,417,300.00	315,430,448.60	11,305,016,790.02
上年度末							
2015年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	11,140,932.04	-	-	-	-	-	11,140,932.04
结算备付金	110,031,214.94	-	-	-	-	-	110,031,214.94
存出保证金	206,460.32	-	-	-	-	-	206,460.32
交易性金融资产	68,444,661.60	44,471,500.00	419,690,855.24	554,938,811.00	8,956,458,400.00	-	10,044,004,227.84
应收证券清算款		-	-	-	-	4,578,871.16	4,578,871.16
应收利息		-	-	-	-	190,456,738.57	190,456,738.57
应收申购款		-	-	-	-	6,317,922.17	6,317,922.17

资产总计	189,823,268.90	44,471,500.00	419,690,855.24	554,938,811.00	8,956,458,400.00	201,353,531.90	10,366,736,367.04
负债							
卖出回购金融资产款	2,539,997,725.00	-	-	-	-	-	2,539,997,725.00
应付赎回款	-	-	-	-	-	11,292,113.48	11,292,113.48
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,500,458.44	2,500,458.44
应付托管费	-	-	-	-	-	833,486.14	833,486.14
应付销售服务费	-	-	-	-	-	859,180.38	859,180.38
应付交易费用	-	-	-	-	-	81,164.40	81,164.40
应付利息	-	-	-	-	-	445,205.56	445,205.56
其他负债	-	-	-	-	-	2,852,343.42	2,852,343.42
负债总计	2,539,997,725.00	-	-	-	-	18,863,951.82	2,558,861,676.82
利率敏感度缺口	-2,350,174,456.10	44,471,500.00	419,690,855.24	554,938,811.00	8,956,458,400.00	182,489,580.08	7,807,874,690.22

注：表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	该利率敏感性分析基于本基金报表日的利率风险状况；		
	假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他变量不变；		
	此项影响并未考虑管理层为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2016 年 6 月 30 日）	上年度末（2015 年 12 月 31 日）
	利率增加 25 基准点	-287,053,177.81	-161,085,324.25
	利率减少 25 基准点	294,555,587.55	164,788,261.70

6.4.13.4.2 外汇风险

无。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的

影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。

本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的其他价格风险。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。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高于基金资产的 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%。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日		上年度末 2015年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	-	-	-	-
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	16,295,593,995.74	144.14	10,044,004,227.84	128.64
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	16,295,593,995.74	144.14	10,044,004,227.84	128.64

注：1. 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高于基金资产的 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%。

2. 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。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

注：于 2016 年 6 月 30 日和 2015 年 12 月 31 日，本基金主要投资于债券，因此除市场利率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	16,295,593,995.74	96.30
	其中：债券	16,295,593,995.74	96.30
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	298,389,413.36	1.76
7	其他各项资产	327,676,116.83	1.94
8	合计	16,921,659,525.93	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。

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

7.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期无买入股票明细。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期无卖出股票明细。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期无买入卖出股票交易。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	2,023,710,175.40	17.90
2	央行票据	-	-
3	金融债券	12,992,992,000.00	114.93
	其中：政策性金融债	12,992,992,000.00	114.93
4	企业债券	583,457,820.34	5.16
5	企业短期融资券	10,004,000.00	0.09
6	中期票据	10,031,000.00	0.09
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	地方政府债	675,399,000.00	5.97
9	其他	-	-
10	合计	16,295,593,995.74	144.14

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。

7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	150314	15 进出 14	18,200,000	1,891,526,000.00	16.73
2	140222	14 国开 22	10,800,000	1,207,008,000.00	10.68
3	150308	15 进出 08	11,200,000	1,198,960,000.00	10.61
4	130231	13 国开 31	10,700,000	1,128,529,000.00	9.98
5	140229	14 国开 29	7,800,000	828,048,000.00	7.32

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

7.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**7.10.1 本期国债期货投资政策**

本基金于报告期内没有投资国债期货。

7.10.2 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。

7.10.3 本期国债期货投资评价

本基金于报告期内没有投资国债期货。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 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。

7.11.2 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。

7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	48,495.64
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	324,172,429.53
5	应收申购款	3,455,191.66
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	327,676,116.83

7.11.4 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。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 8 基金份额持有人信息**8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
工银添利债券 A	11,665	374,477.95	4,140,651,965.40	94.79%	227,633,299.44	5.21%
工银添利债券 B	6,046	790,801.46	4,572,269,109.75	95.63%	208,916,518.81	4.37%
合计	17,711	516,598.21	8,712,921,075.15	95.23%	436,549,818.25	4.77%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	工银添利债券 A	47,386.22	0.00%
	工银添利债券 B	141,403.04	0.00%
	合计	188,789.26	0.00%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
----	------	-------------------

本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	工银添利债券 A	0
	工银添利债券 B	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	工银添利债券 A	0
	工银添利债券 B	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	工银添利债券 A	工银添利债券 B
基金合同生效日（2008 年 4 月 14 日）基金份额总额	2,257,211,189.56	2,571,853,528.73
本报告期期初基金份额总额	2,997,282,631.29	2,767,826,828.68
本报告期基金总申购份额	3,204,073,572.59	5,813,988,020.31
减：本报告期基金总赎回份额	1,833,070,939.04	3,800,629,220.43
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	4,368,285,264.84	4,781,185,628.56

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。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人：

基金管理人于 2016 年 1 月 30 日发布《工银瑞信基金管理有限公司关于副总经理变更的公告》，江明波先生、杜海涛先生、赵紫英女士自 2016 年 1 月 29 日起担任工银瑞信基金管理有限公司副总经理。

2、基金托管人托管部门：

本报告期，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略未有改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金的审计机构为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙），该审计机构自基金合同生效日起向本基金提供审计服务，无改聘情况。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信建投	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-

注：1. 券商的选择标准和程序

(1) 选择标准：注重综合服务能力

a) 券商财务状况良好、经营行为规范、风险管理先进、投资风格与工银瑞信有互补性、在最近一年内无重大违规行为。

b) 券商具有较强的综合研究能力：能及时、全面、定期提供高质量的关于宏观、行业、资本市场、个股分析报告及其他丰富全面的信息咨询服务；有很强的分析能力，能根据工银瑞信所管理基金的特定要求，提供专门研究报告；具有开发量化投资组合模型的能力以及其他综合服务能力。

c) 与其他券商相比，该券商能够提供最佳交易执行和优惠合理的佣金率。

(2) 选择程序

a) 新增券商的选定：根据以上标准对券商进行考察、选择和确定。在合作之前，券商需提供至少两个季度的服务，并与其他已合作券商一起参与投资研究部门（权益投资部，固定收益部，专户投资部，研究部和中央交易室）两个季度对券商的研究服务评估。公司投委会根据对券商研究服务评估结果决定是否作为新增合作券商。

b) 签订委托协议：与被选择的券商签订委托代理协议，明确签定协议双方的公司名称、委托代理期限、佣金率、双方的权利义务等，经签章有效。

2. 券商的评估，保留和更换程序

(1) 席位的租用期限暂定为一年，合同到期 15 天内，投资研究部门将根据各券商研究在服务期间的综合证券服务质量等情况，进行评估。

(2) 对于符合标准的券商，工银瑞信将与其续约；对于不能达到标准的券商，不与其续约，并根据券商选择标准和程序，重新选择其它经营稳健、研究能力强、综合服务质量高的证券经营机构，租用其交易席位。

(3) 若券商提供的综合证券服务不符合要求，工银瑞信有权按照委托协议规定，提前中止租用其交易席位。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中信建投	248,309,123.70	34.26%	2,880,000,000.00	0.95%	-	-
长江证券	476,382,332.70	65.74%	300,532,000,000.00	99.05%	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	工银瑞信基金管理有限公司关于浙江金观诚财富管理有限公司费率调整的公告	中国证监会指定的媒介	2016年1月12日
2	工银瑞信信用添利债券型证券投资基金第十次分红公告	中国证监会指定的媒介	2016年1月12日
3	工银瑞信基金管理有限公司关于增加北京创金启富投资管理有限公司为旗下基金销售机构并实行费率优惠的公告	中国证监会指定的媒介	2016年1月29日
4	工银瑞信基金管理有限公司关于增加中证金牛(北京)投资咨询有限公司为旗下基金销售机构并实行费率优惠的公告	中国证监会指定的媒介	2016年1月29日
5	工银瑞信基金管理有限公司关于副总经理变更的公告	中国证监会指定的媒介	2016年1月30日
6	工银瑞信基金管理有限公司关于增加和耕传承基金销售有限公司为旗下基金销售机	中国证监会指定的媒介	2016年2月3日

	构并实行费率优惠的公告		
7	工银瑞信基金管理有限公司关于中国银河证券股份有限公司费率调整的公告	中国证监会指定的媒介	2016 年 2 月 24 日
8	工银瑞信基金管理有限公司关于增加浙商银行股份有限公司为旗下基金销售机构的公告	中国证监会指定的媒介	2016 年 3 月 4 日
9	工银瑞信基金管理有限公司北京分公司关于营业场所变更的公告	中国证监会指定的媒介	2016 年 3 月 15 日
10	关于增加太平洋证券股份有限公司为工银瑞信基金管理有限公司旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会指定的媒介	2016 年 3 月 22 日
11	工银瑞信基金管理有限公司关于深圳市新兰德证券投资咨询有限公司费率调整的公告	中国证监会指定的媒介	2016 年 4 月 5 日
12	工银瑞信基金管理有限公司关于增加奕丰金融服务（深圳）有限公司为旗下基金销售机构并实行费率优惠的公告	中国证监会指定的媒介	2016 年 4 月 22 日
13	工银瑞信基金管理有限公司关于中证金牛（北京）投资咨询有限公司费率调整的公告	中国证监会指定的媒介	2016 年 5 月 7 日
14	关于工银瑞信基金管理有限公司网上交易支付宝渠道关闭基金支付服务的公告	中国证监会指定的媒介	2016 年 5 月 11 日
15	关于工银瑞信基金管理有限公司淘宝基金店关闭申购服务的公告	中国证监会指定的媒介	2016 年 5 月 11 日
16	工银瑞信基金管理有限公司关于增加珠海盈米财富管理有限公司为旗下基金销售机构并进行费率调整的公告	中国证监会指定的媒介	2016 年 6 月 2 日
17	工银瑞信基金管理有限公司关于上海联泰资产管理有限公司费率调整的公告	中国证监会指定的媒介	2016 年 6 月 20 日
18	关于直销电子自助交易系统继续开展基金转换费率优惠活动的公告	中国证监会指定的媒介	2016 年 6 月 28 日
19	工银瑞信基金管理有限公司关于直销渠道招商银行网银	中国证监会指定的媒介	2016 年 6 月 30 日

	支付方式基金申购费率优惠活动的公告		
20	工银瑞信基金管理有限公司关于调整京东金融平台基金申购费率优惠的公告	中国证监会指定的媒介	2016 年 6 月 30 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准工银瑞信信用添利债券型证券投资基金募集的文件
- 2、《工银瑞信信用添利债券型证券投资基金基金合同》
- 3、《工银瑞信信用添利债券型证券投资基金托管协议》
- 4、《工银瑞信信用添利债券型证券投资基金招募说明书》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照
- 7、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告

12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的办公场所。

12.3 查阅方式

投资者可于营业时间免费查阅，或登录基金管理人网站查阅。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。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人——工银瑞信基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-811-9999

网址：www.icbccs.com.cn

