

工银瑞信全球美元债债券型证券投资基金  
(QDII)  
2021 年第 2 季度报告

2021 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

报告送出日期：2021 年 7 月 20 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年7月16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2021年4月1日起至6月30日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	工银全球美元债
基金主代码	003385
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年1月23日
报告期末基金份额总额	71,853,195.39份
投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的前提下,主要通过对境外证券市场的投资级固定收益类金融工具的主动积极管理,力争获取资产的长期增值。
投资策略	本基金将采用多种不同的投资策略,以实现基金资产的增值目标。本基金将通过对全球市场经济发展、财政和货币政策、金融市场环境、证券市场走势等可能影响各证券市场的重要因素的研究和预测,通过分析和比较不同证券市场 and 不同金融工具的收益及风险特征,积极寻找优质的投资机会,并以此确定基金资产在不同国家和地区的配置比例。
业绩比较基准	美银美林 1-10 年期美国总体市场指数 (BofA Merrill Lynch 1-10 Years US Broad Market Index)

	收益率。	
风险收益特征	本基金为债券型基金,其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金及混合型基金,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	
境外资产托管人	英文名称: State Street Bank and Trust Company	
	中文名称: 道富银行	
下属分级基金的基金简称	工银全球美元债 A 类	工银全球美元债 C 类
下属分级基金的交易代码	003385	003387
报告期末下属分级基金的份额总额	67,509,629.53 份	4,343,565.86 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(2021年4月1日-2021年6月30日)	
	工银全球美元债 A 类	工银全球美元债 C 类
1. 本期已实现收益	-153,411.80	-11,190.03
2. 本期利润	-1,546,644.80	-76,585.71
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0167	-0.0177
4. 期末基金资产净值	70,276,407.53	4,462,743.97
5. 期末基金份额净值	1.0410	1.0274

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 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

工银全球美元债 A 类

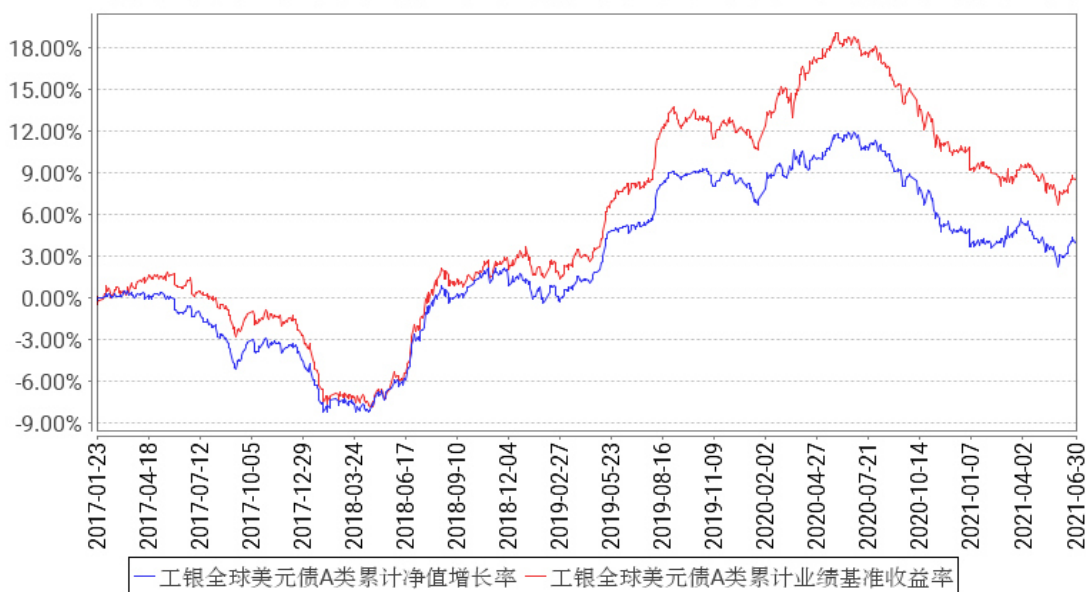
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.53%	0.23%	-0.87%	0.25%	-0.66%	-0.02%
过去六个月	-0.54%	0.25%	-1.74%	0.27%	1.20%	-0.02%
过去一年	-6.96%	0.24%	-8.51%	0.26%	1.55%	-0.02%
过去三年	7.45%	0.23%	11.35%	0.27%	-3.90%	-0.04%
自基金合同生效起至今	4.10%	0.22%	8.66%	0.26%	-4.56%	-0.04%

工银全球美元债 C 类

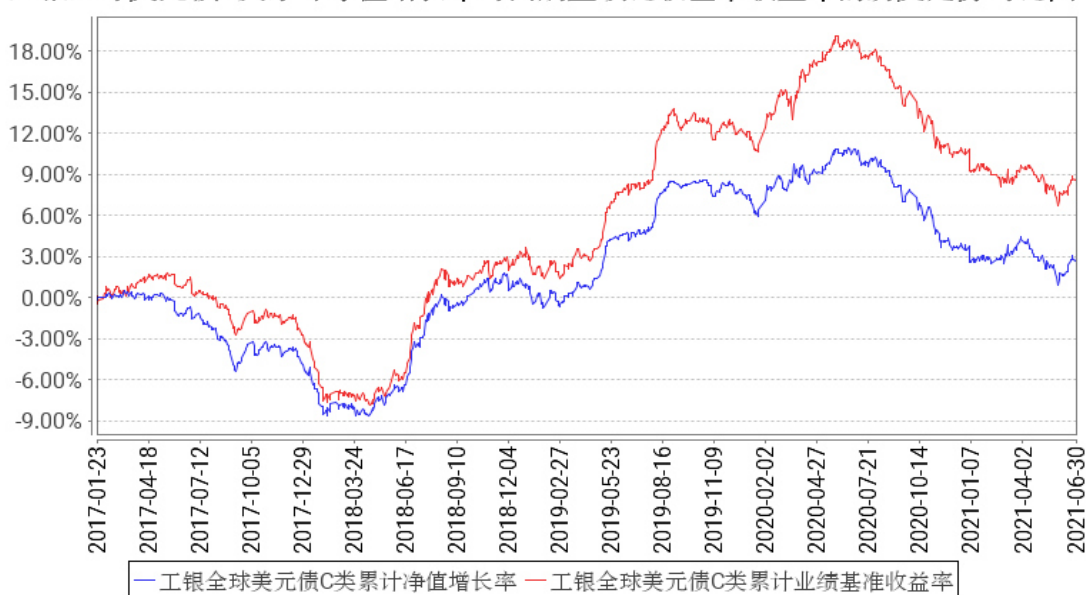
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.64%	0.23%	-0.87%	0.25%	-0.77%	-0.02%
过去六个月	-0.74%	0.25%	-1.74%	0.27%	1.00%	-0.02%
过去一年	-7.33%	0.24%	-8.51%	0.26%	1.18%	-0.02%
过去三年	6.69%	0.23%	11.35%	0.27%	-4.66%	-0.04%
自基金合同生效起至今	2.74%	0.22%	8.66%	0.26%	-5.92%	-0.04%

## 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

工银全球美元债A类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



工银全球美元债C类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 2017 年 1 月 23 日生效。

2、根据基金合同规定，本基金建仓期为 6 个月。截至报告期末，本基金的投资符合基金合同关于投资范围及投资限制的规定：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，其中，投资于美元投资级债券的比例不低于非现金基金资产的 80%；现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

## § 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		
陈涵	本基金的基金经理	2020年2月17日	-	10年	2011年加入工银瑞信，曾任固定收益部宏观利率、信用策略研究员、专户投资部投资经理，现任固定收益部基金经理。2019年6月20日至今，担任工银瑞信中债1-3年农发行债券指数证券投资基金基金经理；2019年6月20日至今，担任工银瑞信中债3-5年国开行债券指数证券投资基金基金经理；2019年8月14日至今，担任工银瑞信中债1-3年国开行债券指数证券投资基金基金经理；2019年10月22日至2021年4月2日，担任工银瑞信中债-国债（7-10年）总指数证券投资基金基金经理；2019年12月23日至今，担任工银瑞信中债1-5年进出口行债券指数证券投资基金基金经理；2020年2月17日至今，担任工银瑞信全球美元债债券型证券投资基金(QDII)基金经理；2020年6月23日至今，担任工银瑞信彭博巴克莱国开行债券1-3年指数证券投资基金基金经理；2020年10月9日至今，担任工银瑞信添慧债券型证券投资基金基金经理；2021年5月26日至今，担任工银瑞信稳健回报60天持有期短债债券型发起式证券投资基金基金经理。

注：1、任职日期为基金合同生效日或本基金管理人对外披露的任职日期；离职日期为本基金管理人对外披露的离职日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

##### 4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期末本基金的基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

##### 4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

本基金本报告期末聘请境外投资顾问。

##### 4.3 报告期内本基金运作合规守信情况说明

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。

#### 4.4 公平交易专项说明

##### 4.4.1 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》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》、《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，制定了《公平交易管理办法》、《异常交易监控管理办法》，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。

##### 4.4.2 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2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。

#### 4.5 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

2021年2季度，受出口订单回流、消费恢复较慢等因素的影响，国内经济弱于预期。国内PPI在基数偏低、大宗商品持续上涨的情况下，同比增速一度达到9%的高位；不过，由于消费需求相对偏弱，价格向中下游的传导尚不明显，国内CPI同比保持低位。海外伴随疫情的稳定、经济活动的正常化，经济增速继续修复，货币政策收紧的预期持续升温，收益率曲线呈现平坦化格局。

本基金在报告期内保持了较低久期，同时继续优化信用债结构。

报告期内，本基金A份额净值增长率为-1.53%，本基金C份额净值增长率为-1.64%，业绩比较基准收益率为-0.87%。

#### 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（人民币元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	-	-
	其中：普通股	-	-
	优先股	-	-
	存托凭证	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	84,759,292.12	83.81
	其中：债券	84,759,292.12	83.81
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
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	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	15,605,960.65	15.43
8	其他资产	766,586.52	0.76
9	合计	101,131,839.29	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 报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

### 5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

### 5.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权益投资明细



#### 5.4.1 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及存托凭证投资明细

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

#### 5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

债券信用等级	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
投资级	84,759,292.12	113.41
非投资级	-	-
未评级	-	-

注：上述债券投资组合采用国际权威机构发布的债券评级。

#### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	XS2243171233	AGRBK 1 10/22/23	8,398,130	8,433,822.05	11.28
2	XS2206800885	CHEVBK Float 08/03/23	6,460,100	6,467,270.71	8.65
3	US06428YAA47	BOCHKL 5.9 PERP	5,168,080	5,571,707.05	7.45
4	XS1900974558	SCCIGC 4 3/4 11/21/21	5,168,080	5,238,727.65	7.01
5	XS1492597676	JNXCCC 3 1/8 10/11/21	5,168,080	5,187,305.26	6.94

注：1、以上债券代码为 ISIN 码。

2、数量列示债券面值，外币按照期末估值汇率折为人民币，四舍五入保留整数。

#### 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

## 5.9 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基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

## 5.10 投资组合报告附注

### 5.10.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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

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。

### 5.10.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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。

### 5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（人民币元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	625,587.73
5	应收申购款	140,998.79
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	766,586.52

### 5.10.4 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。

### 5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

### 5.10.6 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

项目	工银全球美元债 A 类	工银全球美元债 C 类
报告期期初基金份额总额	92,813,613.62	4,386,994.44
报告期期间基金总申购份额	3,271,674.66	1,066,419.32
减:报告期期间基金总赎回份额	28,575,658.75	1,109,847.90
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	67,509,629.53	4,343,565.86

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

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	20210401-20210629	24,967,540.57	-	24,967,540.57	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
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

工银瑞信全球美元债券型证券投资基金(QDII)根据《公开募集证券投资基金侧袋机制指引(试行)》的规定,对《基金合同》和《托管协议》进行了修订,修订后的《基金合同》、《托管协议》自 2021 年 4 月 30 日起生效,详见基金管理人在规定媒介上发布的公告。

## § 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全球美元债券型证券投资基金(QDII)募集申请的注册文件;

- 2、《工银瑞信全球美元债债券型证券投资基金(QDII)基金合同》；
- 3、《工银瑞信全球美元债债券型证券投资基金(QDII)托管协议》；
- 4、《工银瑞信全球美元债债券型证券投资基金(QDII)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规定媒介上披露的各项公告。

## 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。

工银瑞信基金管理有限公司

2021年7月20日