

工银瑞信 60 天理财债券型证券投资基金 2014 年半年度报告摘要

2014 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：兴业银行股份有限公司

送出日期：二〇一四年八月二十九日

§ 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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2014 年 8 月 25 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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2014 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	工银 60 天理财债券	
基金主代码	485122	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013 年 1 月 28 日	
基金管理人	工银瑞信基金管理有限公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,930,389,840.05 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	工银 60 天理财债券 A	工银 60 天理财债券 B
下属分级基金的交易代码:	485122	485022
报告期末下属分级基金的份额总额	1,522,737,266.63 份	407,652,573.42 份

2.2 基金产品说明

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	本基金的业绩比较基准为人民币七天通知存款税后利率。
风险收益特征	本基金为债券型基金，预期收益和风险水平低于混合型基金、股票型基金，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	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	朱碧艳	吴荣
	联系电话	400-811-9999	021-62677777-213117
	电子邮箱	customerservice@icbccs.com.cn	011693@cib.com.cn
客户服务电话		400-811-9999	95561
传真		010-66583158	021-62535823

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.icbccs.com.cn
基金半年度报告报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

§ 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 60 天理财债券 A	工银 60 天理财债券 B
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2014 年 1 月 1 日 - 2014 年 6 月 30 日)	报告期(2014 年 1 月 1 日 - 2014 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	22,969,654.12	6,553,284.80
本期利润	22,969,654.12	6,553,284.80
本期净值收益率	2.8641%	3.0113%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014 年 6 月 30 日)	
期末基金资产净值	1,522,737,266.63	407,652,573.42
期末基金份额净值	1.0000	1.0000

注：1、本基金收益分配是按日结转份额；

2、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。

3、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，由于短期理财债券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。

4、本基金基金合同生效日为 2013 年 1 月 28 日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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 60 天理财债券 A

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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
过去一个月	0.4207%	0.0037%	0.1110%	0.0000%	0.3097%	0.0037%
过去三个月	1.3733%	0.0056%	0.3366%	0.0000%	1.0367%	0.0056%
过去六个月	2.8641%	0.0053%	0.6695%	0.0000%	2.1946%	0.0053%
过去一年	5.3670%	0.0049%	1.3500%	0.0000%	4.0170%	0.0049%
自基金合同生效起至今	6.8045%	0.0050%	1.9196%	0.0000%	4.8849%	0.0050%

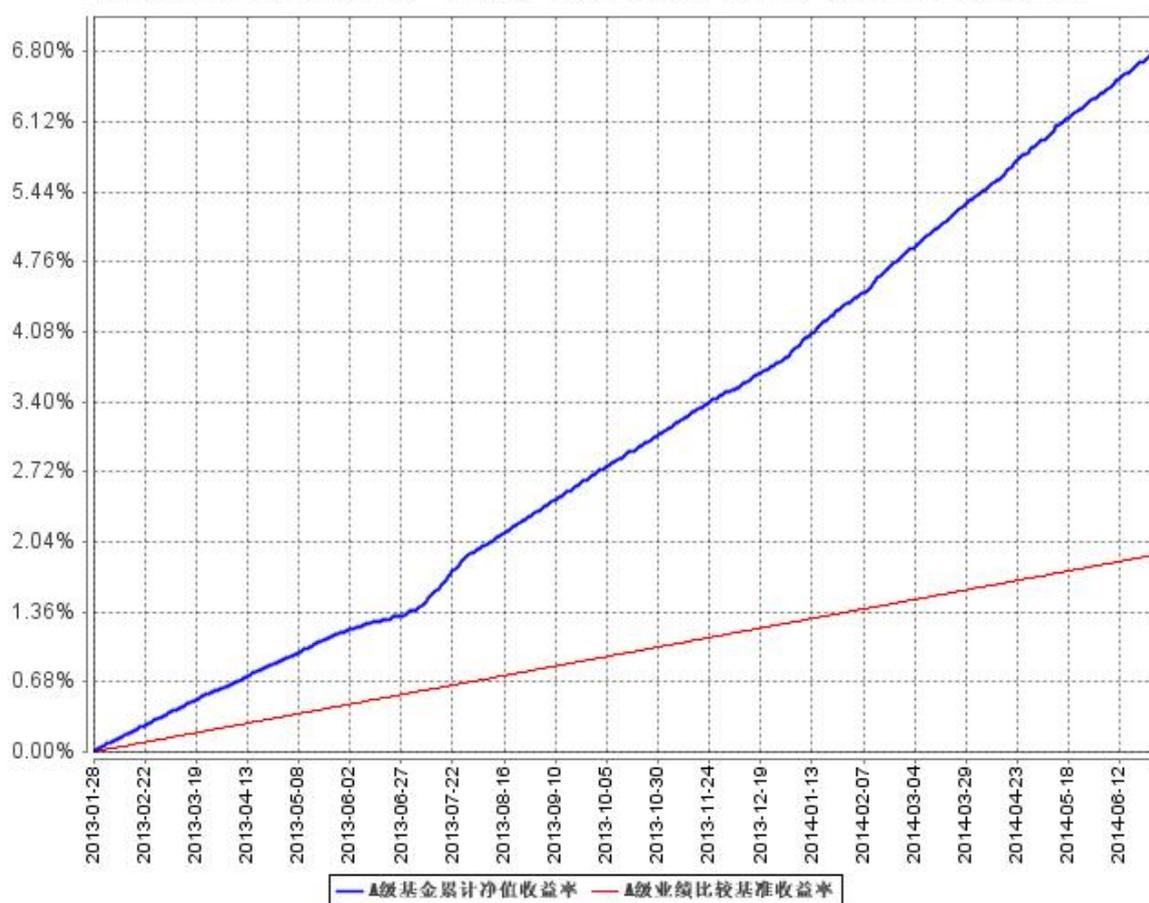
工银 60 天理财债券 B

阶段	份额净值 收益率①	份额净值 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
过去一个月	0.4446%	0.0037%	0.1110%	0.0000%	0.3336%	0.0037%
过去三个月	1.4459%	0.0056%	0.3366%	0.0000%	1.1093%	0.0056%
过去六个月	3.0113%	0.0053%	0.6695%	0.0000%	2.3418%	0.0053%
过去一年	5.6729%	0.0049%	1.3500%	0.0000%	4.3229%	0.0049%
自基金合同 生效起至今	7.2484%	0.0050%	1.9196%	0.0000%	5.3288%	0.0050%

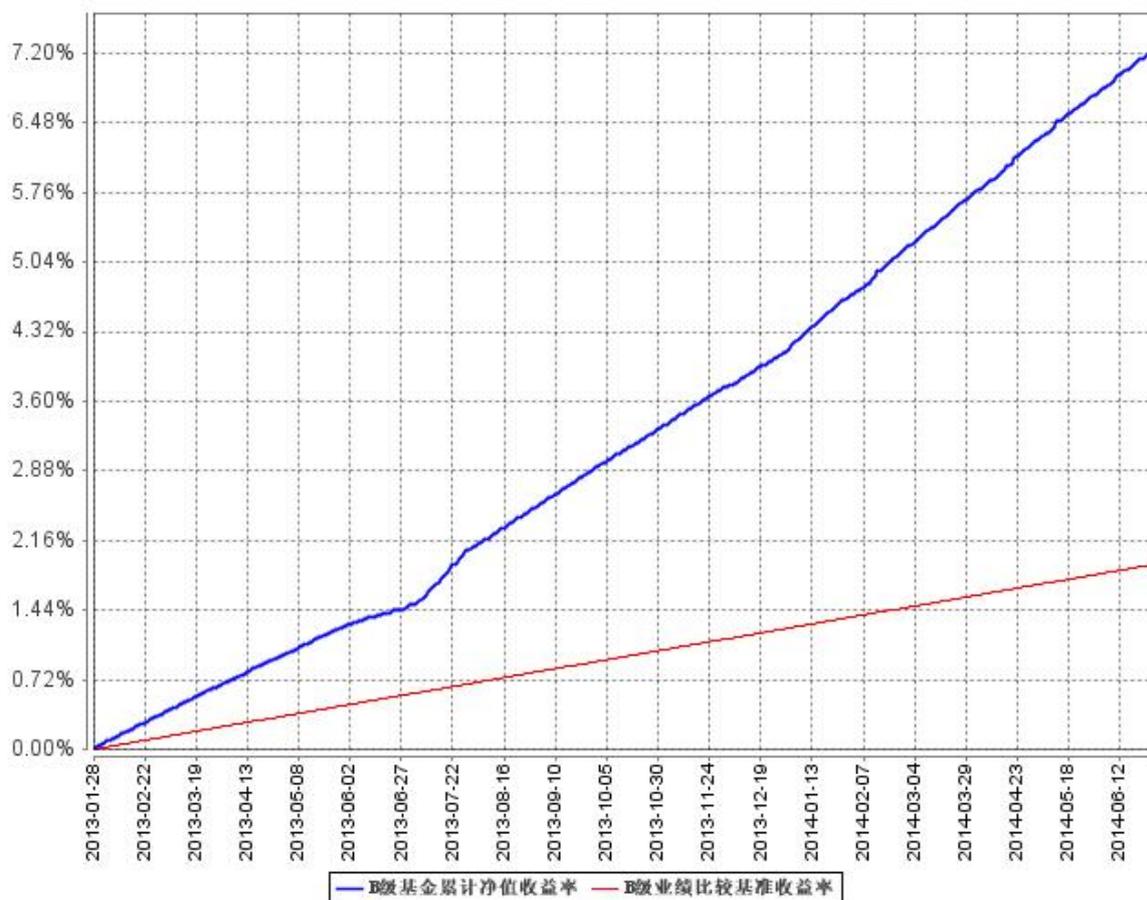
注：本基金基金合同于 2013 年 1 月 28 日生效。

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 2013 年 1 月 28 日生效。

2、按基金合同规定，本基金建仓期为基金合同生效之日起的 30 个交易日。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：本基金主要投资于具有良好流动性的工具，包括现金、通知存款、一年以内（含一年）的银行定期存款和大额存单、剩余期限（或回售期限）在 397 天以内（含 397 天）的债券、资产支持证券、中期票据；期限在一年以内（含一年）的债券回购、期限在一年以内（含一年）的中央银行票据、短期融资券，及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他固定收益类金融工具；本基金不直接在二级市场上买入股票、权证等权益类资产，也不参与一级市场新股申购和新股增发。

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 2014 年 6 月 30 日，公司旗下管理 45 只开放式基金——工银瑞信核心价值股票型证券投资基金、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、工银瑞信稳健成长股票型证券投资基金、工银瑞信增强收益债券型证券投资基金、工银瑞信红利股票型证券投资基金、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、工银瑞信大盘蓝筹股票型证券投资基金、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股票型证券投资基金、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股票型证券投资基金、工银瑞信添颐债券型证券投资基金、工银瑞信主题策略股票型证券投资基金、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股票型证券投资基金、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、工银瑞信保本 2 号混合型发起式证券投资基金、工银瑞信增利分级债券型证券投资基金、工银瑞信安心增利场内实时申赎货币市场基金、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股票型证券投资基金、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、工银瑞信信息产业股票型证券投资基金、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，证券投资基金管理规模逾 1900 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		
宋炳 坤	本基 金的基 金经 理，研 究部总 监	2013 年1月 28日	-	10	曾任中信建投证券有限公司研究员；2007年加入工银瑞信，现任研究部总监。2012年2月14日至今，担任工银瑞信添颐债券型证券投资基金基金经理；2013年1月18日至今，担任工银双利债券基金基金经理；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；2014年1月20日至今，担任工银红利基金基金经理；2014年1月20日至今，担任工银核心价值基金基金经理。
谷衡	本基 基金经 理	2013 年1月 28日	-	9	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，现任固定收益部基金经理；2012年11月13日起至今担任工银瑞信14天理财债券型发起式证券投资基金基金经理；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日至今，担任工银安心场内实时申赎货币基金基金经理。

注：

1、任职日期说明：宋炳坤的任职日期为基金合同生效日期。

谷衡的任职日期为基金合同生效日期。

2、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。

3、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。

本报告期内，本基金曾买入一只发行主体评级为 AA+ 的超短期融资券“14 电科院 SCP001”，其主体评级低于《基金合同》关于超短期融资券的要求，基金托管人发现上述情形后及时通知基金管理人，基金管理人于第四个交易日将该只债券全部卖出，未给基金财产造成损失。

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；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未超过该证券当日成交量的 5%。

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，全球宏观经济共振程度加强，主要经济体环比增速先降后升。国内整体通胀压力较低，工业产能过剩令 PPI 同比增速持续处在负值区间，但跌幅有所收窄；CPI 走势则较为平稳。在经济偏弱且通胀压力较低的情况下，为保证经济增长不滑出“下限”，二季度央行出台了定向降准、定向再贷款等一系列货币政策。

上半年货币市场利率和短期债券收益率持续下行。隔夜 Shibor 利率月度均值从 1 月份的 3.44% 下降至 6 月份的 2.70%；1 年期国开债收益率从年初的 5.49% 大幅回落至 4.28%；一年期 AAA 级别短融收益率从 6.27% 回落至 4.73%，一年期 AA+ 级别短融收益率从 6.73% 回落至 5.04%。

上半年，由于对市场利率走势较为乐观，本基金采取了较为积极的操作策略，适度提高了债券仓位，并保持相对较高的组合期限和杠杆；同时，通过对组合规模的判断，合理安排组合内生现金流，平衡组合流动性与收益。在信用产品等级选择上，我们严格执行信用产品内部评级配置要求，降低组合信用风险暴露。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，工银 60 天理财 A 的收益率为 2.8641%，工银 60 天理财 B 的收益率为 3.0113%，业

绩比较基准收益率为 0.6695%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们认为海外需求好转和国内货币政策宽松将带动中国经济环比改善。全年通胀压力不大，但其上行压力可能会在今年四季度显现。虽然经济底部温和回升，但我们判断货币政策转紧的概率较低。预计三季度，存款和短融收益率存在进一步下行空间。我们将密切关注实体经济需求好转和通胀回升情况，以及资金价格的上行压力，及时调整我们下半年的资产配置。

本基金在下半年将维持信用产品配置的中高等级水平，严格控制低评级信用产品和中长期 Shibor 浮息债持仓比例，继续努力做好组合内生现金流的安排，并进行适当的期限管理，重点在月末季末把握好存款的投资机会。此外，本基金将密切关注新股申购对基金规模及货币市场利率带来的冲击。

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

1、本基金根据每日各类基金份额收益情况，以基金净收益为基准，为投资者每日计算当日各

类基金份额的收益并分配，并在运作期到期日集中支付。本基金各类基金份额每日进行收益计算并分配，累计收益支付方式只采用红利再投资（即红利转基金份额）方式。

2、本基金 A 级于本报告期间累计应分配利润 22,969,654.12 元，累计分配收益 22,969,654.12 元，其中以红利再投资方式结转入实收基金 22,856,228.04 元，计入应付利润 113,426.08 元。本基金 B 级于本报告期间累计应分配利润 6,553,284.80 元，累计分配收益 6,553,284.80 元，其中以红利再投资方式结转入实收基金 6,508,417.76 元，计入应付利润 44,867.04 元。

§ 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

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查。本基金报告期内曾买入一只发行主体评级为 AA+ 的超短期融资券“14 电科院 SCP001”，其主体评级低于《基金合同》关于超短期融资券的要求，基金托管人发现上述情形后及时通知基金管理人，基金管理人于第四个交易日将该只债券全部卖出，未给基金财产造成损失。。除此，未发现基金管理人存在任何损害本基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认真复核了本半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，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 60 天理财债券型证券投资基金
报告截止日：2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2014 年 6 月 30 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
资产:			
银行存款		1,162,094,006.48	279,796,714.08
结算备付金		-	1,603,087.12
存出保证金		13,392.69	30,188.36
交易性金融资产		1,271,157,636.96	501,238,600.27
其中: 股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		1,271,157,636.96	501,238,600.27
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		-	97,867.30
应收利息		19,335,380.07	8,984,995.86
应收股利		-	-
应收申购款		10,279,581.65	1,385,952.00
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		2,462,879,997.85	793,137,404.99
负债和所有者权益	附注号	本期末 2014 年 6 月 30 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
负债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		530,898,949.65	230,399,218.50
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		414,695.02	141,215.41
应付托管费		122,872.60	41,841.62
应付销售服务费		373,246.56	144,977.19
应付交易费用		44,273.71	26,991.72
应交税费		-	-
应付利息		208,250.04	78,383.30
应付利润		225,964.60	67,671.48
递延所得税负债		-	-
其他负债		201,905.62	243,000.67
负债合计		532,490,157.80	231,143,299.89
所有者权益:			
实收基金		1,930,389,840.05	561,994,105.10
未分配利润		-	-
所有者权益合计		1,930,389,840.05	561,994,105.10

负债和所有者权益总计		2,462,879,997.85	793,137,404.99
------------	--	------------------	----------------

注：1、报告截止日 2014 年 6 月 30 日，基金份额净值为人民币 1.0000 元，基金份额总额 1,930,389,840.05 份，其中 A 类基金份额为 1,522,737,266.63 份；B 类基金份额为 407,652,573.42 份。

2、本基金基金合同生效日为 2013 年 1 月 28 日。

6.2 利润表

会计主体：工银瑞信 60 天理财债券型证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2013 年 1 月 28 日(基金 合同生效日)至 2013 年 6 月 30 日
一、收入		36,965,161.04	117,528,593.17
1.利息收入		34,099,346.23	118,079,517.20
其中：存款利息收入		19,061,910.35	106,572,865.54
债券利息收入		14,952,016.38	10,450,162.69
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		85,419.50	1,056,488.97
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		2,865,814.16	-1,510,924.03
其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益		2,865,814.16	-1,510,924.03
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		0.65	960,000.00
减：二、费用		7,442,222.12	21,653,365.41
1. 管理人报酬		1,416,951.76	7,228,267.91
2. 托管费		419,837.61	2,156,227.58
3. 销售服务费		1,247,849.57	6,624,554.47
4. 交易费用		-	-
5. 利息支出		4,129,043.61	5,453,303.17

其中：卖出回购金融资产支出		4,129,043.61	5,453,303.17
6. 其他费用		228,539.57	191,012.28
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		29,522,938.92	95,875,227.76
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		29,522,938.92	95,875,227.76

注：本基金基金合同生效日为 2013 年 1 月 28 日。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：工银瑞信 60 天理财债券型证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 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）	561,994,105.10	-	561,994,105.10
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	29,522,938.92	29,522,938.92
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）	1,368,395,734.95	-	1,368,395,734.95
其中：1. 基金申购款	2,579,030,811.04	-	2,579,030,811.04
2. 基金赎回款	-1,210,635,076.09	-	-1,210,635,076.09
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）	-	-29,522,938.92	-29,522,938.92
五、期末所有者权益（基金净值）	1,930,389,840.05	-	1,930,389,840.05
项目	上年度可比期间 2013 年 1 月 28 日（基金合同生效日）至 2013 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）	-	-	-
二、本期经营活动产生	-	95,875,227.76	95,875,227.76

的基金净值变动数（本期利润）			
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）	1,345,096,703.45	-	1,345,096,703.45
其中：1.基金申购款	13,862,139,770.66	-	13,862,139,770.66
2.基金赎回款	-12,517,043,067.21	-	-12,517,043,067.21
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）	-	-95,875,227.76	-95,875,227.76
五、期末所有者权益（基金净值）	1,345,096,703.45	-	1,345,096,703.45

注：本基金基金合同生效日为 2013 年 1 月 28 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：

_____ 郭特华	_____ 毕万英	_____ 朱辉毅
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 60 天理财债券型证券投资基金（以下简称“本基金”），系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[2012] 1606 号文《关于核准工银瑞信 60 天理财债券型证券投资基金募集的批复》的核准，由工银瑞信基金管理有限公司作为发起人于 2013 年 1 月 17 日至 2013 年 1 月 24 日向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具（2013）验字第 60802052_A02 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2013 年 1 月 28 日正式生效，本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金设立时，A 类基金收到首次募集（不含认购费）的有效净认购金额为人民币 10,390,194,640.55 元，折合 10,390,194,640.55 份 A 类基金份额；募集资金在募集期间产生的利息为人民币 742,263.03 元，折合 742,263.03 份 A 类基金份额；以上收到的实收基金共计人民币 10,390,936,903.58 元，折合 10,390,936,903.58 份 A 类基金份额。B 类基金收到首次募集（不含认购费）的有效净认购金额为人民币 2,465,193,000.00 元，折合 2,465,193,000.00 份 B 类基金份额；募集资金在募集期间产生的利息为人民币 155,231.94 元，折合 155,231.94 份 B 类基金份额；以上收到的实收基金共计人民币 2,465,348,231.94 元，折合 2,465,348,231.94 份 B 类基金份额。A 类及 B 类基金收到的实收基金合计人民币 12,856,285,135.52 元，分别折合成 A 类和 B 类基金份额，合计折合

12,856,285,135.52 份基金份额。

本基金不收取申购赎回费用，而对投资者持有的基金份额按照不同的费率计提销售服务费。本基金 A 类基金份额的销售服务费年费率为 0.30%，B 类基金份额的销售服务费年费率为 0.01%。本基金的基金管理人和注册登记机构均为工银瑞信基金管理有限公司，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

本基金主要投资于具有良好流动性的工具，包括现金、通知存款、一年以内（含一年）的银行定期存款和大额存单、剩余期限（或回售期限）在 397 天以内（含 397 天）的债券、资产支持证券、中期票据；期限在一年以内（含一年）的债券回购、期限在一年以内（含一年）的中央银行票据、短期融资券，及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他固定收益类金融工具。本基金不直接在二级市场上买入股票、权证等权益类资产，也不参与一级市场新股申购和新股增发。

本基金的业绩比较基准为：人民币七天通知存款税后利率。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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〉》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

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 2014 年 6 月 30 日的财务状况以及 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计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

1. 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资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。

2. 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入、储蓄存款利息收入，由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。

根据财政部、国家税务总局财税字[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 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。

6.4.7.2 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
兴业银行股份有限公司	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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 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。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	2013 年 1 月 28 日 (基金合同生效日) 至 2013 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,416,951.76	7,228,267.91
其中：支付销售机构的客户维护费	625,283.59	3,335,881.16

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.27% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.27\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	2013 年 1 月 28 日 (基金合同生效日) 至 2013 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	419,837.61	2,156,227.58

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.08% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.08\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。

6.4.8.2.3 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
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费

	工银 60 天理财债券 A	工银 60 天理财债券 B	合计
工银瑞信基金管理有限公司	74,276.81	9,100.23	83,377.04
中国工商银行股份有限公司	647,017.98	1,267.08	648,285.06
兴业银行股份有限公司	8,126.10	83.94	8,210.04
合计	729,420.89	10,451.25	739,872.14
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2013 年 1 月 28 日(基金合同生效日)至 2013 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	工银 60 天理财债券 A	工银 60 天理财债券 B	合计
工银瑞信基金管理有限公司	3,530.78	17,912.70	21,443.48
中国工商银行股份有限公司	6,360,847.10	30,391.03	6,391,238.13
兴业银行股份有限公司	189,888.65	1,994.58	191,883.23
合计	6,554,266.53	50,298.31	6,604,564.84

注：本基金 A 类基金份额的销售服务费年费率为 0.30%，对于由 B 类降级为 A 类的基金份额持有人，基金年销售服务费率应自其达到 A 类条件的开放日后的下一个工作日起适用 A 类基金份额持有人的费率。

本基金 B 类基金份额的销售服务费年费率为 0.01%，对于由 A 类升级为 B 类的基金份额持有人，基金年销售服务费率应自其达到 B 类条件的开放日后的下一个工作日起适用 B 类基金份额持有人的费率。

各级基金份额的销售服务费计提的计算方法如下：

$$H=E \times R / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金销售服务费

E 为前一日的基金资产净值

R 为该级基金份额的销售服务费年费率

基金销售服务费每日计提，按月支付。

6.4.8.3 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			
2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日			
银行间市场交易	债券交易金额	基金逆回购	基金正回购

的各关联方名称	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
兴业银行股份有限公司	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2013 年 1 月 28 日(基金合同生效日)至 2013 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
兴业银行股份有限公司	30,027,678.64	-	-	-	-	-

注：本基金本报告期无与关联方进行的银行间同业市场债券（含回购）交易

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的管理人在本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

6.4.8.4.2 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及上年度可比期间均未投资本基金。

6.4.8.5 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 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2013 年 1 月 28 日(基金合同生效日)至 2013 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
兴业银行股份有 限公司	212,094,006.48	2,684,903.14	5,844,014.61	10,276,033.42
中国工商银行股 份有限公司	-	116,666.67	40,000,000.00	34,737,639.20

注：1、本半年度末余额仅为活期存款，利息收入包括活期存款和存款投资收入。

2、上年度可比期末余额 5,844,014.61 元为兴业银行股份有限公司保管的活期存款，其余部分为定期存款投资，利息收入包括活期存款和存款投资收入。

6.4.8.6 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 期末（2014 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 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/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2014 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人民币 530,898,949.65 元，是以如下债券作为质押：

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
011474001	14 陕煤化 SCP001	2014 年 7 月 1 日	100.00	300,000	30,000,076.23
011480001	14 兖矿 SCP001	2014 年 7 月 1 日	99.91	300,000	29,972,611.01
011480002	14 兖矿 SCP002	2014 年 7 月 1 日	100.03	700,000	70,022,525.49
041354055	13 蒙东 CP001	2014 年 7 月 1 日	100.11	100,000	10,011,185.26
041359078	13 桂铁投 CP001	2014 年 7 月 1 日	101.36	200,000	20,271,522.93
041454017	14 阳泉 CP001	2014 年 7 月 1 日	99.86	300,000	29,956,736.96
041459017	14 云工投 CP001	2014 年 7 月 1 日	100.05	200,000	20,009,461.23
041459030	14 柳工 CP001	2014 年 7 月 1 日	100.00	300,000	30,000,124.69
041460050	14 湘高速 CP002	2014 年 7 月 1 日	100.00	300,000	30,001,066.28
041461012	14 津城建 CP001	2014 年 7 月 1 日	100.42	600,000	60,251,454.75
041464012	14 晋焦煤 CP001	2014 年 7 月 1 日	99.94	300,000	29,980,852.48
041464026	14 甘国投 CP001	2014 年 7 月 1 日	100.00	500,000	50,000,124.09
041466007	14 冀水泥 CP002	2014 年 7 月 1 日	100.04	400,000	40,015,791.00
041455019	14 苏广播 CP001	2014 年 7 月 4 日	100.01	1,000,000	100,006,515.53
合计				5,500,000	550,500,047.93

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未发生交易所市场债券正回购，未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.10 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	固定收益投资	1,271,157,636.96	51.61

	其中：债券	1,271,157,636.96	51.61
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	-	-
	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	1,162,094,006.48	47.18
4	其他各项资产	29,628,354.41	1.20
5	合计	2,462,879,997.85	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 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

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	24.05	
	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	530,898,949.65	27.50
	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 40% 的说明

本报告期内本基金债券正回购的资金余额未超过基金资产净值的 40%。

7.3 基金投资组合平均剩余期限

7.3.1 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	171
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	179
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	123

报告期内投资组合平均剩余期限超过 180 天情况说明

本报告期内无投资组合平均剩余期限超过 180 天情况。

7.3.2 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	各期限负债占基金资
----	--------	------------	-----------

		净值的比例 (%)	产净值的比例 (%)
1	30 天以内	0.63	27.50
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	16.58	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	26.42	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—180 天	34.21	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	180 天(含)—397 天(含)	48.22	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	126.05	27.50

7.4 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	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	1,271,157,636.96	65.85
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	1,271,157,636.96	65.85
9	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。

7.5 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	041455019	14 苏广播 CP001	1,000,000	100,006,515.53	5.18
2	011480002	14 究矿	700,000	70,022,525.49	3.63

		SCP002			
3	041461012	14 津城建 CP001	600,000	60,251,454.75	3.12
4	041451011	14 晋煤 CP001	500,000	50,372,808.30	2.61
5	011420004	14 中铝 SCP004	500,000	50,026,647.59	2.59
6	011489001	14 鞍钢股 SCP001	500,000	50,003,173.81	2.59
7	041459042	14 包钢集 CP002	500,000	50,001,729.14	2.59
8	011415005	14 中铝业 SCP005	500,000	50,000,136.22	2.59
9	041464026	14 甘国投 CP001	500,000	50,000,124.09	2.59
10	041453023	14 攀钢 CP001	500,000	49,999,053.46	2.59

注：上表中，债券的成本包括债券面值和折溢价。

7.6 “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	36
报告期内偏离度的最高值	0.3065%
报告期内偏离度的最低值	-0.2240%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1882%

注：上表中“偏离情况”根据报告期内各交易日数据计算。

7.7 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。

7.8 投资组合报告附注

7.8.1 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。

7.8.2 报告期内本基金未持有剩余期限小于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券。

7.8.3 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。

7.8.4 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	13,392.69
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	19,335,380.07
4	应收申购款	10,279,581.65
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	29,628,354.41

7.8.5 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 60 天理财债券 A	26,131	58,273.21	7,848,232.03	0.52%	1,514,889,034.60	99.48%
工银 60 天理财债券 B	30	13,588,419.11	317,316,146.37	77.84%	90,336,427.05	22.16%
合计	26,161	73,788.84	325,164,378.40	16.84%	1,605,225,461.65	83.16%

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 60 天理财债券 A	911,757.10	0.06%
	工银 60 天理	-	-

	财债券 B		
	合计	911,757.10	0.05%

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 60 天理财债券 A	0~10
	工银 60 天理财债券 B	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	工银 60 天理财债券 A	0
	工银 60 天理财债券 B	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	工银 60 天理财债券 A	工银 60 天理财债券 B
基金合同生效日（2013 年 1 月 28 日）基金份额总额	10,135,833,732.68	2,720,451,402.84
本报告期期初基金份额总额	519,882,172.53	42,111,932.57
本报告期基金总申购份额	1,816,490,838.64	762,539,972.40
减：本报告期基金总赎回份额	813,635,744.54	396,999,331.55
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	1,522,737,266.63	407,652,573.42

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，本基金未召开持有人大会。

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：

本报告期，基金管理人未发生重大人事变动。

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人、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

无

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安永华明会计师事务所（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

本报告期内管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

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	2	-	-	-	-	-

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、个股分析的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) 确定券商数量：根据以上标准对不同券商进行考察、选择和确定。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）根据公司基金规模和服务需求等因素确定对合作券商的数量，每年根据公司经营规模变化及券商评估结果决定是否需要新增或调整合作券商，选定的名单需经主管投资副总和总经理审批同意。

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。委托代理协议一式五份，协议双方及证券主管机关各留存一份，工银瑞信法律合规部留存备案，并报相关证券主管机关留存报备。

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。

证券公司的变更情况

无。

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	52,228,313.07	100.00%	390,000,000.00	100.00%	-	-

10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

无。

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

无。
