

---

工银瑞信全球美元债债券型证券投资基金  
(QDII) 更新的招募说明书摘要

(2018 年第 1 号)

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

## 重要提示

本基金经中国证券监督管理委员会2016年9月5日证监许可（2016）2019号文注册募集。本基金基金合同于2017年1月23日正式生效，自该日起基金管理人正式开始管理本基金。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。

投资有风险，投资者认购（或申购）基金份额时应认真阅读本招募说明书，全面认识本基金产品的风险收益特征，应充分考虑投资者自身的风险承受能力，并对认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化导致的投资风险，由投资者自行承担。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

本基金为境外证券投资的基金，本基金投资过程中面临的主要风险有：市场风险、利率风险、信用风险、再投资风险、流动性风险、操作风险、汇率风险、国家/地区市场风险、法律和政治风险等。

本基金为债券型基金，预期收益和风险水平高于货币市场基金，低于混合型基金与股票型基金。同时，本基金为境外证券投资的基金，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险之外，本基金还面临汇率风险、国际不同国家的宏观经济风险等海外市场投资所面临的特别投资风险。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

基金管理人管理的其它基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人依照

恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

本招募说明书所载内容截止日为2018年1月22日，有关财务数据和净值表现数据截止日为2017年12月31日（财务数据未经审计）。本招募说明书已经基金托管人复核。

## 一、基金管理人

### （一）基金管理人概况

名称：工银瑞信基金管理有限公司

住所：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

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

邮政编码：100033

法定代表人：郭特华

成立日期：2005年6月21日

批准设立机关：中国证监会

批准设立文号：中国证监会证监基金字[2005]93号

经营范围：基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务

组织形式：有限责任公司

注册资本：贰亿元人民币

联系人：朱碧艳

联系电话：400-811-9999

股权结构：中国工商银行股份有限公司占公司注册资本的80%；瑞士信贷银行股份有限公司占公司注册资本的20%。

存续期间：持续经营

### （二）主要人员情况

#### 1、董事会成员

尚军先生，董事长，中国工商银行战略管理与投资者关系部资深专家、专职派出董事。复旦大学工商管理（国际）硕士，高级经济师。历任中国工商银行河南郑州分行团委书记、国际部副总经理，河南分行国际部副总经理、储蓄处处长、国际业务处处长，河南分行副

行长、党委委员，陕西分行党委书记、行长等职务。

Michael Levin 先生，董事，瑞士信贷董事总经理、亚太地区资产管理主管。Levin 先生负责制定和指导亚太区资产管理战略，包括销售、产品和合作伙伴关系。他还与机构和私人银行密切合作，以提供资产管理投资解决方案。在 2011 年 8 月加入瑞士信贷之前，Levin 先生是 AsiaCrest Capital 的首席执行官，AsiaCrest Capital 是一家位于香港的对冲基金 FoF。再之前，他曾在 Hite Capital 和英仕曼集团担任投资组合经理。Levin 先生也是 Metropolitan Venture Partners 的联合创始人。他在流动和非流动性另类投资行业拥有超过 20 年的经验。Levin 先生毕业于美国宾夕法尼亚大学沃顿商学院，并获得经济学学士学位。

郭特华女士，董事，博士，现任工银瑞信基金管理有限公司总经理，兼任工银瑞信资产管理（国际）有限公司董事长。历任中国工商银行总行商业信贷部、资金计划部副处长，中国工商银行总行资产托管部处长、副总经理。

王一心女士，董事，高级经济师。中国工商银行战略管理与投资者关系部高级专家、专职董事。历任中国工商银行专项融资部（公司业务二部、营业部）副总经理；中国工商银行营业部 历任副处长、处长；中国工商银行总行技术改造信贷部经理。

王莹女士，董事，高级会计师，中国工商银行战略管理与投资者关系部高级专家、专职派出董事，于 2004 年 11 月获得国际内审协会注册内部审计师（Certified Internal Auditor）资格证书。历任中国工商银行国际业务部外汇清算处负责人，中国工商银行清算中心外汇清算处负责人、副处长，中国工商银行稽核监督局外汇业务稽核处副处长、处长，中国工商银行内部审计局境外机构审计处处长，工行悉尼分行内部审计师、风险专家。

田国强先生，独立董事，经济学博士。上海财经大学经济学院院长，上海财经大学高等研究院院长，美国德州 A&M 大学经济系 Alfred F. Chalk 讲席教授。首批中组部“千人计划”入选者及其国家特聘专家，首批人文社会科学长江学者讲座教授，曾任上海市人民政府特聘决策咨询专家，中国留美经济学会会长（1991-1992）。2006 年被《华尔街电讯》列为中国大陆十大最具影响力的经济学家之一。主要研究领域包括经济理论、激励机制设计、中国经济等。

孙祁祥女士，独立董事，经济学博士。北京大学经济学院院长，教授，博士生导师，享受国务院政府特殊津贴专家。兼任北京大学中国保险与社会保障研究中心主任，中国金融学会学术委员会委员、常务理事，中国保险学会副会长，教育部高等学校经济学类学科专业教学指导委员会委员，美国国际保险学会董事会成员、学术主持人，美国 C.V. Starr 冠名教授。曾任亚太风险与保险学会主席、美国国家经济研究局、美国印第安纳大学、美国哈佛大学、

香港大学访问学者。在《经济研究》等学术刊物上发表论文100多篇，主持过20多项由国家部委和国际著名机构委托的科研课题。

Jane DeBevoise女士,独立董事, 香港大学艺术系博士。历任银行家信托公司（1998年与德意志银行合并）董事总经理、所罗门·古根海姆基金会副主席及项目总监、香港政府委任的展览馆委员会成员、香港西九龙文娱艺术馆咨询小组政府委任委员。2003年至今担任香港亚洲艺术文献库董事局董事及主席，2009年至今担任美国亚洲艺术文献库总裁。

## 2、监事会成员

郑剑锋先生, 监事, 金融学科学双硕士。2005年12月起, 郑剑锋先生任职于中国工商银行监事会办公室, 先后担任综合管理处处长、监督专员和监事会办公室副主任, 主要负责风险、内控及董事高管履职的监督检查工作。2014年6月起, 郑剑锋先生被任命为中国工商银行战略管理与投资者关系部集团派驻子公司董监事办公室高级专家、专职派出董事。

黄敏女士, 监事, 金融学学士。黄敏女士于2006年加入Credit Suisse Group (瑞士信贷集团), 先后担任全球投资银行战略部助理副总裁、亚太区投资银行战略部副总裁、中国区执行首席运营官, 资产管理大中国区首席运营官, 现任资产管理中国区负责人。

洪波女士, 监事, 硕士。ACCA 非执业会员。2005年至2008年任安永华明会计师事务所高级审计员; 2008年至2009年任民生证券有限责任公司监察稽核总部业务主管; 2009年6月加入工银瑞信法律合规部, 现任内控稽核部总监。

倪莹女士, 监事, 硕士。2000年至2009年任职于中国人民大学, 历任副科长、科长, 校团委副书记。2009年至2011年就职于北京市委教工委, 任干部处副调研员。2011年加入工银瑞信战略发展部, 现任战略发展部总监。

章琼女士, 监事, 硕士。2001年至2003年任职于富友证券财务部; 2003年至2005年任职于银河基金, 担任注册登记专员。2005年加入工银瑞信运作部, 现任运作部总监。

## 3、高级管理人员

郭特华女士, 总经理, 简历同上。

朱碧艳女士, 硕士, 国际注册内部审计师, 现任工银瑞信基金管理有限公司督察长, 兼任工银瑞信投资管理有限公司监事。1997—1999年中国华融信托投资公司证券总部经理, 2000—2005年中国华融资产管理公司投资银行部、证券业务部高级副经理。

江明波先生, 硕士, 现任工银瑞信基金管理有限公司副总经理, 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。2000年7月至2001年11月, 任职于长城证券有限责任公司, 担任研究员; 2001年12月至2006年12月, 任职于鹏

华基金管理有限公司，历任研究员、基金经理助理、普天债券基金经理、社保债券组合、社保回购组合基金经理、机构理财部总监助理、固定收益小组负责人。2006年加入工银瑞信基金管理有限公司。

杜海涛先生，硕士，现任工银瑞信基金管理有限公司副总经理，兼任工银瑞信资产管理（国际）有限公司董事，1997年7月至2002年9月，任职于长城证券有限责任公司，历任职员、债券（金融工程）研究员；2002年10月至2003年5月，任职于宝盈基金管理有限公司，历任研究员、基金经理助理；2003年6月至2006年3月，任职于招商基金管理有限公司，历任研究员、基金经理。2006年加入工银瑞信基金管理有限公司。

赵紫英女士，博士，现任工银瑞信基金管理有限公司副总经理，1989年8月至1993年5月，任职于中国工商银行海淀支行，从事国际业务；1994年6月至2002年4月，任职于中国工商银行北京市分行国际业务部，历任综合科科长、国际业务部副总经理；2002年5月至2005年6月，任职于中国工商银行牡丹卡中心，历任市场营销部副总经理、清算部副总经理。2005年加入工银瑞信基金管理有限公司。

郝炜先生，硕士，现任工银瑞信基金管理有限公司副总经理，兼任工银瑞信资产管理（国际）有限公司董事，工银瑞信投资管理有限公司董事。2001年4月至2005年6月，任职于中国工商银行资产托管部。2005年加入工银瑞信基金管理有限公司。

#### 4、本基金基金经理

刘琦先生，9年证券从业经验；北京大学概率统计专业博士；曾先后在嘉实基金管理有限公司担任基金经理助理、研究员，在嘉实国际担任助理副总裁，在易方达基金担任基金经理。2015年加入工银瑞信，现任固定收益部基金经理。2015年11月10日至今，担任工银月月薪定期支付债券型基金基金经理；2016年10月14日至今，担任工银瑞信新焦点灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2016年11月2日至今，担任工银瑞信瑞盈18个月定期开放债券型证券投资基金基金经理；2017年1月4日至今，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；2017年1月23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。

#### 5、投资决策委员会成员

郭特华女士，简历同上。

江明波先生，简历同上

杜海涛先生，投资决策委员会主任，简历同上。

宋炳坤先生，13年证券从业经验；曾任中信建投证券有限公司研究员；2007年加入工

银瑞信，现任权益投资总监。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2014年12月5日，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，担任工银瑞信红利混合型证券投资基金基金经理；2014年1月20日至2017年5月27日，担任工银瑞信核心价值混合型证券投资基金基金经理；2014年10月23日至今，担任工银瑞信研究精选股票型基金基金经理；2014年11月18日至今，担任工银医疗保健行业股票型基金基金经理；2015年2月16日至2017年12月22日，担任工银战略转型主题股票基金基金经理；2017年4月12日至今，担任工银瑞信中国制造2025股票型证券投资基金基金经理。

欧阳凯先生，15年证券从业经验；曾任中海基金管理有限公司基金经理；2010年加入工银瑞信，现任固定收益投资总监。2010年8月16日至今，担任工银双利债券型基金基金经理，2011年12月27日至2017年4月21日担任工银保本混合基金基金经理，2013年2月7日至2017年2月6日担任工银保本2号混合型发起式基金（自2016年2月19日起变更为工银瑞信优质精选混合型证券投资基金）基金经理，2013年6月26日起至今担任工银瑞信保本3号混合型基金基金经理，2013年7月4日起至今担任工银信用纯债两年定期开放基金基金经理，2014年9月19日起至今担任工银新财富灵活配置混合型基金基金经理，2015年5月26日起至今担任工银丰盈回报灵活配置混合型基金基金经理。

黄安乐先生，14年证券从业经验；先后在天相投资顾问有限公司担任研究员，国信证券经济研究所担任资深分析师，国信证券资产管理总部担任投资经理、研究员；2010年加入工银瑞信，现任权益投资总监。2011年11月23日至今，担任工银瑞信主题策略混合型证券投资基金基金经理；2013年9月23日至今，担任工银瑞信精选平衡基金基金经理；2014年10月22日至2017年10月9日，担任工银高端制造行业股票型基金基金经理；2015年4月28日至今，担任工银新材料新能源行业股票型基金基金经理；2016年1月29日至今，担任工银瑞信国家战略主题股票型基金基金经理；2017年4月21日至今，担任工银瑞信互联网加股票型证券投资基金基金经理。

李剑峰先生，14年证券从业经验；曾任中央国债登记结算有限责任公司业务经理、高级副经理；2008年加入工银瑞信，曾任固定收益研究员，现任固定收益投资总监兼养老金投资中心总经理。

郝康先生，17年证券从业经验；先后在澳大利亚首源投资管理公司担任基金经理，在联和运通投资顾问管理公司担任执行董事，在工银瑞信担任国际业务总监，在工银瑞信资产管

理（国际）有限公司担任副总经理；2016年加入工银瑞信基金管理有限公司，现任权益投资总监，兼任工银瑞信（国际）投资总监，2016年12月30日至今，担任工银瑞信沪港深股票型证券投资基金基金经理；2017年11月9日至今，担任工银瑞信沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

上述人员之间均不存在近亲属关系。

## 二、基金托管人

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：田国立

成立时间：2004 年 09 月 17 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12 号

联系人：田 青

联系电话：(010)6759 5096

## 三、相关服务机构

### （一）基金份额发售机构

#### 1、直销机构

名称：工银瑞信基金管理有限公司

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

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

法定代表人：郭特华

全国统一客户服务电话：400-811-9999

传真：010-66583111

联系人：王秋雅

公司网站：[www.icbccs.com.cn](http://www.icbccs.com.cn)

直销机构可以办理本基金人民币份额的申购业务。投资者还可通过本公司电子自助交易系统申购本基金的人民币份额。本基金管理人的直销机构和电子自助交易系统不支持美元份额的申购。

## 2、可以办理本基金人民币份额申购的其他销售机构

### （1）中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人：易会满

传真：010—66107914

客户服务电话：95588

网址：<http://www.icbc.com.cn/>

### （2）中国建设银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：王洪章

联系人：张静

传真：010—66275654

客户服务电话：95533

网址：<http://www.ccb.com/>

### （3）招商银行股份有限公司

注册地址：深圳市福田区深南大道 7088 号

办公地址：深圳市福田区深南大道 7088 号

法定代表人：李建红

联系人：邓炯鹏

电话：0755—83198888

传真：0755—83195049

客户服务电话：95555

网址：<http://www.cmbchina.com/>

### （4）中信证券股份有限公司

注册地址：深圳市深南路 7088 号招商银行大厦 A 层

办公地址：北京朝阳区新源南路 6 号京城大厦

法定代表人：王东明

联系人：陈忠

电话：010—84588888

传真：010—84865560

客户服务电话：010-84588888

网址：<http://www.cs.ecitic.com/>

（5）中信证券（山东）有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区苗岭路 29 号澳柯玛大厦 15 层

办公地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 20 层

法定代表人：杨宝林

联系人：吴忠超

电话：0532-85022326

传真：0532-85022605

客户服务电话：95548

网址：<http://www.zxwt.com.cn>

（6）中信期货有限公司

注册地址：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305 室、  
14 层

办公地址：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305 室、  
14 层

法定代表人：张皓

联系人：韩钰

电话：010-6083 3754

传真：010-5776 2999

客户服务电话：400-990-8826

网址：[www.citicsf.com](http://www.citicsf.com)

（7）华西证券股份有限公司

注册地址：四川省成都市陕西街 239 号

办公地址：四川省成都市高新区天府二街 198 号华西证券大厦

法定代表人：杨炯阳

联系人：金达勇

电话：0755—83025723

传真：0755—83025991

客户服务电话：4008888818

网址：<http://www.hx168.com.cn>

（8）大同证券有限责任公司

注册地址：山西省大同市大北街 13 号

办公地址：太原市长治路 111 号山西世贸中心 A 座 F12、F13

法定代表人：董祥

联系人：薛津

电话：0351—4130322

传真：0351—4192803

客户服务电话：4007121212

（9）大有期货有限公司

注册地址：湖南省长沙市天心区芙蓉南路二段 128 号现代广场三、四楼

办公地址：湖南省长沙市天心区芙蓉南路二段 128 号现代广场三、四楼

法定代表人：沈众辉

电话：0731-84409000

传真：0731-84409009

客户服务电话：4006-365-058

网址：[www.dayouf.com](http://www.dayouf.com)

（10）江海证券有限公司

注册地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

办公地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

法定代表人：孙名扬

联系人：张宇宏

电话：0451—82336863

传真：0451—82287211

客户服务电话：4006662288

网址：<http://www.jhzq.com.cn>

（11）天相投资顾问有限公司

注册地址：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701 邮编：100032

办公地址：北京市西城区新街口外大街 28 号 C 座 5 层

法定代表人：林义相

联系人：谭磊

电话：010—66045182

传真：010—66045518

客户服务电话：010-66045678

网址：<http://www.txsec.com>

（12）深圳众禄基金销售股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、J 单元

办公地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、J 单元

法定代表人：薛峰

联系人：童彩萍

联系电话：0755-33227950

传真：0755-82080798

客户服务电话：4006-788-887

网址：[www.zlfund.cn](http://www.zlfund.cn) 及 [www.jjmmw.com](http://www.jjmmw.com)

（13）北京展恒基金销售有限公司

注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街 6 号

办公地址：北京市朝阳区德胜门外华严北里 2 号民建大厦 6 层

法定代表人：闫振杰

联系人：宋丽冉

联系电话：010-62020088

客服电话：4008-886-661

传真：62020088-8802

网址：[www.myfund.com](http://www.myfund.com)

（14）上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 449 室

办公地址：上海市浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 9 楼

法定代表人：杨文斌

联系人：薛年

联系电话：021-58870011-6705

客服电话：400-700-9665

传真：021-68596916

网址：<http://www.howbuy.com/>

（15）浙江金观诚基金销售有限公司

注册地址：拱墅区霞湾巷 239 号 8 号楼 4 楼 403 室

办公地址：杭州市教工路 18 号 EAC 欧美中心 A 座 D 区 8 层

法定代表人：陆彬彬

联系人：鲁盛

联系电话：0571-56028617

客服电话：400-068-0058

传真：0571-56899710

网址：[www.jincheng-fund.com](http://www.jincheng-fund.com)

（16）上海利得基金销售有限公司

注册地址：上海市宝山区蕴川路 5503 号 A425 室

办公地址：上海浦东新区峨山路 91 弄 61 号陆家嘴软件园 10 号楼 14 楼

法定代表人：李兴春

联系人：曹怡晨

联系电话：021-50583533

客服电话：400-921-7755

传真：021-50583633

网址：[www.leadfund.com.cn](http://www.leadfund.com.cn)

（17）嘉实财富管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区世纪大道 8 号 B 座 46 楼 06-10 单元

办公地址：北京市朝阳区建国路 91 号金地中心 A 座 6 层

法定代表人：赵学军

联系人：景琪

联系电话：010- 65215266

客服电话：400-021-8850

传真：010-65185678

网址：<http://www.harvestwm.cn/>

（18）众升财富（北京）基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区望京东园四区 13 号楼 A 座 9 层 908 室

办公地址：北京市朝阳区望京浦项中心 A 座 9 层 04-08

法定代表人：李招弟

联系人：李艳

联系电话：010-59497361

客服电话：400-876-9988

传真：010-64788016

网址：[www.zscffund.com](http://www.zscffund.com)

（19）浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦 903 室

办公地址：浙江省杭州市翠柏路 7 号杭州电子商务产业园 2 号楼 2 楼

法定代表人：凌顺平

联系人：杨翼

联系电话：0571-88911818

客服电话：4008-773-772

网址：[www.5ifund.com](http://www.5ifund.com)

（20）上海长量基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

办公地址：上海市浦东新区浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 层

法定代表人：张跃伟

联系人：单丙焱

联系电话：021-20691832

客服电话：400-089-1289

传真：021-20691861

网址: <http://www.erichfund.com>

(21) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

注册地址: 深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006#

办公地址: 北京市西城区宣武门外大街 28 号富卓大厦 16 层

法定代表人: 杨懿

联系人: 张燕

联系电话: 0755-88394666

客服电话: 4008-166-1188

传真: 0755-88394677

网址: <http://8.jrj.com.cn/>

(22) 宜信普泽投资顾问(北京)有限公司

注册地址: 北京市朝阳区建国路 88 号 9 号楼 15 层 1809

办公地址: 北京市朝阳区建国路 88 号 SOHO 现代城 C 座 1809

法定代表人: 戎兵

联系人: 魏晨

联系电话: 010-52413385

客服电话: 400-609-9200

网址: [www.yixinfund.com](http://www.yixinfund.com)

(23) 通华财富(上海)基金销售有限公司

注册地址: 上海市虹口区同丰路 667 弄 107 号 201 室

办公地址: 上海市浦东新区金桥路 28 号新金桥大厦 5 楼

法定代表人: 周盛

联系人: 金昌明

联系电话: 021-61766938

客服电话: 400-669-5156

网址: <https://www.tonghuafund.com>

(24) 中国国际期货有限公司

注册地址: 北京市朝阳区建国门外光华路 14 号 1 幢 1 层、2 层、9 层、11 层、12 层

办公地址: 北京市朝阳区光华路 16 号中期大厦 A 座 9 层

法定代表人: 王兵

联系人：赵森

联系电话：010-65807399

客服电话：95162

网址：[www.cifco.net](http://www.cifco.net)

（25）中期资产管理有限公司

注册地址：北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢11层1103号

办公地址：北京市朝阳区建国门外光华路16号中国中期大厦A座11层

法定代表人：路瑶

联系人：侯英建

联系电话：010-65807865

客服电话：010-65807609

网址：[www.cifcofund.com](http://www.cifcofund.com)

（26）北京唐鼎耀华投资咨询有限公司

注册地址：北京市延庆县延庆经济开发区百泉街10号2栋236室

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路甲40号二十一世纪大厦A303

法定代表人：杨涛

联系人：周君

联系电话：010-53570568

客服电话：400-819-9868

网址：[www.tdyhfund.com](http://www.tdyhfund.com)

（27）海银基金销售有限公司

注册地址：中国(上海)自由贸易试验区银城中路8号402室

办公地址：上海市浦东新区银城中路8号4楼

法定代表人：刘惠

联系人：毛林

电话：021-80133597

传真：021-80133413

客服电话：400-808-1016

网址：[www.fundhaiyin.com](http://www.fundhaiyin.com)

（28）海银基金销售有限公司

注册地址：中国(上海)自由贸易试验区银城中路8号402室

办公地址：上海市浦东新区银城中路8号4楼

法定代表人：刘惠

联系人：毛林

电话：021-80133597

传真：021-80133413

客服电话：400-808-1016

网址：[www.fundhaiyin.com](http://www.fundhaiyin.com)

(29) 上海陆金所基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路1333号14楼09单元

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼

法定代表人：郭坚

联系人：宁博宇

电话：021-20665952

传真：021-22066653

客户服务电话：4008219031

网址：[www.lufunds.com](http://www.lufunds.com)

(30) 北京虹点基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区西大望路1号1号楼16层1603室

办公地址：北京市朝阳区西大望路1号1号楼16层1603室

法定代表人：胡伟

联系人：张婷婷

电话：010-66045608

传真：010-66045500

客户服务电话：400-068-1176

网址：[www.hongdianfund.com](http://www.hongdianfund.com)

(31) 深圳富济财富管理有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）

办公地址：深圳市南山区科苑南路高新南七道惠恒集团二期418室

法定代表人：刘鹏宇

联系人 刘勇

电话： 0755-83999907-813

传真： 0755-83999926

客户服务电话： 0755-83999907

网址： [www.jinqianwo.cn](http://www.jinqianwo.cn)

(32) 和耕传承基金销售有限公司

注册地址：郑州市郑东新区心怡路西广场路南升龙广场 2 号楼 701

办公地址：郑州市郑东新区心怡路西广场路南升龙广场 2 号楼 701

法定代表人：李淑慧

联系人：裴小龙

电话： 0371-55213196

传真： 0371-85518397

客户服务电话：4000-555-671

网址： [www.hgccpb.com](http://www.hgccpb.com)

(33) 北京创金启富投资管理有限公司

注册地址：北京市西城区民丰胡同 31 号 5 号楼 215A

办公地址：北京市西城区民丰胡同 31 号 5 号楼 215A

法定代表人：梁蓉

联系人：赵海峰

电话： 010-66154828

传真： 010-88067526

客户服务电话： 010-66154828

网址： [www.5irich.com](http://www.5irich.com)

(34) 中证金牛（北京）投资咨询有限公司

注册地址：北京市丰台区东管头 1 号 2 号楼 2-45 室

办公地址：北京市宣武门外大街甲一号新华社第三工作区 A 座 5 层

法定代表人：彭运年

联系人：孙雯

电话： 010-59336519

传真： 010-59336510

客户服务电话： 4008909998

网址： [www.jnlc.com](http://www.jnlc.com)

(35) 北京钱景基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区丹棱街丹棱 SOHO 1008-1012

办公地址：北京市海淀区丹棱街丹棱 SOHO 1008-1012

法定代表人：赵荣春

联系人：盛海娟

电话： 010-57418813

传真：010-57569671

客户服务电话： 400-893-6885

网址： [www.qianjing.com](http://www.qianjing.com)

(36) 奕丰金融服务（深圳）有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）

办公地址：深圳市南山区海德三道航天科技广场A座17楼1704室

法定代表人：TEO WEE HOWE

联系人：陈广浩

电话： 0755 8946 0500

传真： 0755 2167 4453

客户服务电话：400-684-0500

网址： [www.ifastps.com.cn](http://www.ifastps.com.cn)

(37) 珠海盈米财富管理有限公司

注册地址：珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491

办公地址：广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔12楼B1201-1203

法定代表人：肖雯

联系人：钟琛

电话：020-89629099

传真：020-89629011

客服电话：020-89629066

网址：[www.yingmi.cn](http://www.yingmi.cn)

(38) 北京晟视天下投资管理有限公司

注册地址：北京市怀柔区九渡河镇黄坎村 735 号 03 室

办公地址：北京市朝阳区朝外大街甲 6 号万通中心 D 座 21&28 层

法定代表人：蒋煜

联系人：蒋宸

电话：010-58170911

传真：010-58170800

客户服务电话：400 818 8866

网址：<http://fund.shengshiview.com/>

(39) 北京广源达信基金销售有限公司

注册地址：北京市西城区新街口外大街 28 号 C 座六层 605 室

办公地址：北京市朝阳区宏泰东街浦项中心 B 座 19 层

法定代表人：齐剑辉

联系人：王英俊

电话：010-52798634

传真：010-82055860

客户服务电话：400-623-6060

网址：[www: niuniufund.com](http://www.niuniufund.com)

(40) 上海万得基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路 33 号 8 楼

法定代表人：王廷富

联系人：沈杰

电话：021-5132 7185

传真：021-5071 0161

客户服务电话：400-821-0203

网址：[www.520fund.com.cn](http://www.520fund.com.cn)

(41) 北京恒天明泽基金销售有限公司

注册地址：北京市经济技术开发区宏达北路 10 号五层 5122 室

办公地址：北京市朝阳区东三环北路甲 19 号 SOHO 嘉盛中心 30 层 3001 室

法定代表人：李悦

联系人：张晔

电话：010-56642600

传真：010-56642623

客户服务电话：4008-980-618

网址：[www.chtfund.com](http://www.chtfund.com)

(42) 泰诚财富基金销售（大连）有限公司

注册地址：辽宁省大连市沙河口区星海中龙园 3 号

办公地址：辽宁省大连市沙河口区星海中龙园 3 号

法定代表人：林卓

联系人：姜焕洋

电话：0411-88891212

传真：0411-84396536

客户服务电话：400-0411-001

网址：[www.taichengcaifu.com](http://www.taichengcaifu.com)

(43) 金惠家保险代理有限公司

注册地址：北京市海淀区东升园公寓 1 号楼 1 层南部

办公地址：北京市朝阳区门外大街 18 号丰联广场 A 座 1009

法定代表人：夏予柱

联系人：胡明哲

电话：15810201340

传真：028-62825327

客户服务电话：400-8557333

网址：[www.jhffund.com](http://www.jhffund.com)

(44) 北京新浪仓石基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2 地块新浪总部  
科研楼 5 层 518 室

办公地址：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2 地块新浪总部  
科研楼 5 层 518 室

法定代表人： 李昭琛

联系人： 吴翠

电话： 010-60619607

传真： 8610-62676582

客户服务电话： 010-62675369

网址： [www.xincai.com](http://www.xincai.com)

(45) 北京肯特瑞财富投资管理有限公司

注册地址： 北京市海淀区中关村东路 66 号 1 号楼 22 层 2603-06

办公地址： 北京市亦庄经济开发区科创十一街十八号院京东集团总部 A 座

法定代表人： 江卉

联系人： 万容

电话： 010-89188345

传真： 89189566

客户服务电话： 个人业务： 95118 企业业务： 400 088 8816

网址： <http://fund.jd.com>

(46) 上海华夏财富投资管理有限公司

注册地址： 上海市虹口区东大名路 687 号 1 幢 2 楼 268 室

办公地址： 北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 16 层

法定代表人： 毛淮平

联系人： 仲秋玥

电话： 010-88066632

传真： 010-88066214

客户服务电话： 400-817-5666

网址： [www.amcfortune.com](http://www.amcfortune.com)

(47) 北京蛋卷基金销售有限公司

注册地址： 北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507

办公地址： 北京市朝阳区望京阜通东大街 望京SOHO T3 A座 19层

法定代表人： 钟斐斐

联系人： 戚晓强

电话： 010-61840688

传真： 010-61840699

客户服务电话： 4000618518

网址： <https://danjuanapp.com>

(48) 济安财富（北京）基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区东三环中路7号4号楼40层4601室

办公地址：北京市朝阳区东三环中路7号北京财富中心A座46层

法定代表人： 杨健

联系人： 李海燕

电话： 010-65309516

传真： 010-65330699

客户服务电话： 400-673-7010

网址： [www.jianfortune.com](http://www.jianfortune.com)

(49) 大泰金石基金销售有限公司

注册地址： 南京市建邺区江东中路222号南京奥体中心现代五项馆2105室

办公地址： 上海市浦东新区峨山路505号东方纯一大厦15楼

法定代表人： 袁顾明

联系人： 赵明

电话： 021-20324155

传真： 021-20324199

客户服务电话： 400-928-2266

网址： [www.dtfunds.com](http://www.dtfunds.com)

(50) 上海挖财金融信息服务有限公司

注册地址： 中国（上海）自由贸易试验区杨高南路799号5层01、02、03室

办公地址： 中国（上海）自由贸易试验区杨高南路799号5层01、02、03室

法定代表人： 胡燕亮

联系人： 樊晴晴

电话： 021-50810687

传真： 021-58300279

客户服务电话： 021-50810673

网址： [www.wacaijijin.com](http://www.wacaijijin.com)

（51）华泰证券股份有限公司

注册地址：南京市江东中路 228 号

办公地址：南京市建邺区江东中路 228 号华泰证券广场、深圳市福田区深南大道 401 号港中旅大厦 18 楼

法定代表人：周易

联系人：庞晓芸

电话：0755-82492193

传真：0755-82492962（深圳）

客户服务电话：95597

网址：<http://www.htsc.com.cn/>

（52）山西证券股份有限公司

注册地址：太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼

办公地址：太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼

法定代表人：侯巍

联系人：郭熠

电话：0351-8686659

传真：0351-8686619

客户服务电话：4006661618

网址：<http://www.i618.com.cn/>

3、可以办理本基金美元份额申购的其他销售机构

（1）中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人：易会满

传真：010-66107914

客户服务电话：95588

网址：<http://www.icbc.com.cn/>

（2）中国建设银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：王洪章

联系人：张静

传真：010—66275654

客户服务电话：95533

网址：<http://www.ccb.com/>

（3）招商银行股份有限公司

注册地址：深圳市福田区深南大道 7088 号

办公地址：深圳市福田区深南大道 7088 号

法定代表人：李建红

联系人：邓炯鹏

电话：0755—83198888

传真：0755—83195049

客户服务电话：95555

网址：<http://www.cmbchina.com/>

基金管理人可根据《基金法》、《运作办法》、《销售办法》和本基金基金合同等的规定，选择其他符合要求的机构销售本基金，并及时履行公告义务。

（二）基金登记机构

名称：工银瑞信基金管理有限公司

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

注册登记业务办公地址：北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 A 座 6 层

法定代表人：郭特华

全国统一客户服务电话：400-811-9999

传 真：010-66583100

联系人：朱辉毅

（三）律师事务所及经办律师

名称：上海市通力律师事务所

注册地址：上海市银城中路68号时代金融中心19楼

办公地址：上海市银城中路68号时代金融中心19楼

负责人：俞卫锋

电话：021-31358666

传真：021-31358600

联系人：陈颖华

经办律师：黎明、陈颖华

（四）会计师事务所及经办注册会计师

名称：普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

办公地址：上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

执行事务合伙人：李丹

经办注册会计师：单峰、朱宏宇

联系电话：（021）23238888

传真：（021）23238800

联系人：朱宏宇

#### 四、基金的名称

本基金名称：工银瑞信全球美元债债券型证券投资基金（QDII）

#### 五、基金的类型

本基金类型：债券型。

#### 六、基金的投资目标

在严格控制风险和保持资产流动性的前提下，主要通过对外国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。

#### 七、基金的投资方向

本基金的投资范围包括政府债券、公司债券、住房按揭支持证券、资产支持证券等债券及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券，房地产信托凭证(REITs)、公募基金(包括ETF)、银行存款、可转让存单、银行承兑汇票、银行票据、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具以及中国证监会允许投资的其他金融工具，包括货币远期合约/期货/互

换、利率互换、信用违约互换等金融衍生产品。本基金不主动参与股票等权益类资产的投资，不直接从二级市场买入股票等权益类资产和权证，也不参与一级市场的新股申购或增发新股。

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%。投资级债券指：（1）S&P评级BBB-级及BBB-级以上的债券；（2）或Moody's评级Baa3级及Baa3级以上的债券；（3）或Fitch评级BBB-级及BBB-级以上的债券。

本基金所投资的基金为在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金。

本基金所投资的房地产信托凭证(REITs)为在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的房地产信托凭证(REITs)。

本基金所投资的期货为在经中国证监会认可的境外交易所上市交易的期货。

如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。如法律法规或中国证监会变更投资品种比例限制的，基金管理人在与基金托管人协商一致并履行相关程序后，可相应调整本基金的投资比例规定。

## 八、基金的投资策略

### （一）国家/地区配置策略

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资产配置比例。

### （二）利率策略

利率策略是债券型基金采用的重要策略，主要通过对组合久期的控制实现对利率风险的有效管理。本基金通过深入研究宏观经济运行态势和宏观政策导向，判断市场利率变动的趋势和幅度。运用敏感性分析，模拟利率变动的多种可能性，并根据投资组合的风险承受能力确定组合的目标久期区间。

### （三）汇率策略

本基金将从国际化视野审视各国/地区的经济和资本市场，全面分析影响汇率走势的各种因素，判断主要汇率走势，并适度进行外汇远期、期货、期权等汇率衍生品投资，以降低

外汇风险。

#### （四）收益率曲线策略

收益率曲线形状变化的主要影响因素是宏观经济基本面以及货币政策，而投资者的期限偏好以及各期限的债券供给分布对收益率形状有一定影响。对收益率曲线的分析采取定性和定量相结合的方法。定性方法为：在对经济周期和货币政策分析下，对收益率曲线形状可能变化给予一个方向判断；定量方法为：参考收益率曲线的历史趋势，同时结合未来的各期限的供给分布以及投资者的期限偏好，对未来收益率曲线形状做出判断。

通过对债券市场收益率曲线形状变化的合理预期，调整组合的期限结构策略（主要包括子弹式策略、哑铃式策略和梯式策略），在短期、中期、长期债券间进行配置，从短、中、长期债券的相对价格变化中获取收益。其中，子弹式策略是使投资组合中债券的到期期限集中于收益率曲线的一点；哑铃式策略是将组合中债券的到期期限集中于两端；而梯式策略则是将债券到期期限进行均匀分布。

#### （五）信用策略

根据宏观经济运行周期阶段，分析企业债券、公司债券等发行人所处行业发展前景、业务发展状况、市场竞争地位、财务状况、管理水平和债务水平等因素，评估债券发行人的偿债能力及信用违约风险，并根据特定债券的发行契约，评价债券的信用级别，确定企业债券、公司债券的信用风险利差，及其与其他同行业或同市场债券之间的相对价值。

基于本基金的投资范围，债券发行人在各国/地区的经济中的重要地位，和其所可能得到的直接或间接的政府支持也将是对发行人的一个重要考核因素。

#### （六）资产支持证券投资策略

资产支持证券主要包括资产抵押贷款支持证券（ABS）、住房抵押贷款支持证券（MBS）等证券品种。本基金将重点对市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等影响资产支持证券价值的因素进行分析，并辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型，评估资产支持证券的相对投资价值并做出相应的投资决策。

#### （七）衍生品投资

基于对风险的准确度量与控制，在基金风险承受能力许可的范围内，本着谨慎原则，以提高基金资产的运作效率和实现稳定增值为目标，适当参与衍生品投资，买卖交易所交易和场外交易的衍生工具，包括利率期货、掉期、外汇远期、掉期；信用违约掉期等。此外，在严格控制风险的前提下，本基金将适度参与证券借贷交易、回购交易等投资，以增加收益。

## 九、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：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。

美银美林1-10年期美国总体市场指数是美银美林开发的跟踪美国市场公开发行1-10年期的美元计价的投资级债券指数，本基金管理人认为，该业绩比较基准目前能够忠实地反映本基金的风险收益特征。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，经与基金托管人协商一致，本基金可在履行适当必要程序后，变更业绩比较基准并及时公告，而无需召开基金份额持有人大会审议。

## 十、风险收益特征

本基金为债券型基金，预期收益和风险水平高于货币市场基金，低于混合型基金与股票型基金。同时，本基金为境外证券投资的基金，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险之外，本基金还面临汇率风险、国际不同国家的宏观经济风险等海外市场投资所面临的特别投资风险。

## 十一、基金的投资组合报告

本报告期为2017年10月1日起至12月31日止（财务数据未经审计）。

### 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	139,610,347.82	94.48
	其中：债券	139,610,347.82	94.48
	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	7,348,083.89	4.97
8	其他资产	807,882.28	0.55
9	合计	147,766,313.99	100.00

注：由于四舍五入的原因市值占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

## 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。

## 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。

## 4. 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. 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（%）
Aa1 至 Aa3	-	-
A1 至 A3	52,925,758.89	36.02
Baa1 至 Baa3	58,979,621.37	40.14
未评级	27,704,967.56	18.86

注：上述债券投资组合采用国际权威机构穆迪发布的债券评级。

## 6. 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	XS1573944524	SDBC 0 03/06/20	14,375,240	14,358,708.47	9.77
2	XS1472473203	BOCOM 0 08/16/19	9,801,300	9,823,842.99	6.69
3	XS1252209165	BCHINA 2 1/8 06/30/18	9,801,300	9,790,420.56	6.66
4	XS1001851994	SBSG 3 3/4 12/12/18	9,147,880	9,205,969.04	6.27

5	USG8200QAA43	SINOPE 2 1/2 10/17/18	7,841,040	7,847,391.24	5.34
---	--------------	--------------------------	-----------	--------------	------

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。

#### 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投资。

#### 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。

#### 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投资。

#### 10. 投资组合报告附注

10.1 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。

10.2 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。

#### 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	104,138.81
3	应收股利	-
4	应收利息	703,689.82
5	应收申购款	53.65
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	807,882.28

#### 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可转换债券。

#### 10.5 报告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投资，因此不存在流通受限情况。

## 10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

## 十二、基金的业绩

基金管理人承诺以恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不向投资者保证最低收益。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。

1、本基金合同生效日为2017年1月23日，基金合同生效以来（截至2017年12月31日）的投资业绩及同期基准的比较如下表所示：

工银美元债A

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)
2017. 1. 23-2017. 12. 31	-4.54%	0.18%	-2.71%	0.21%	-1.83%	-0.03%

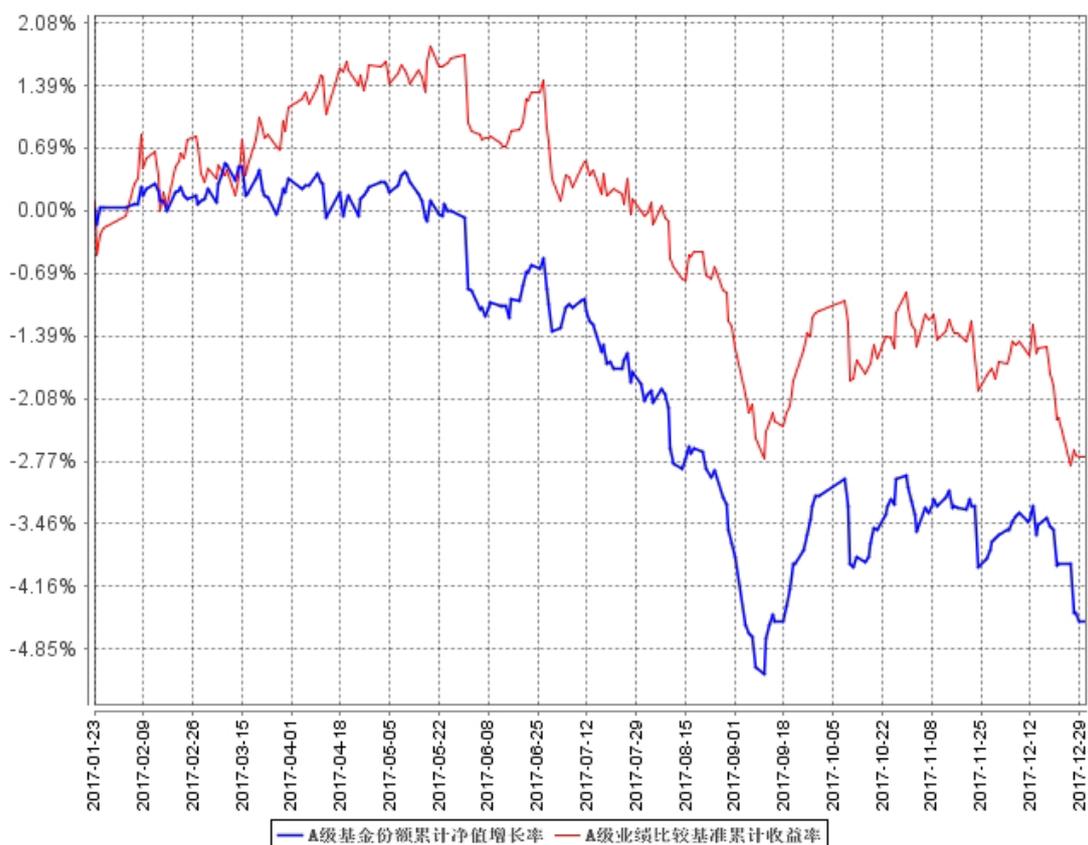
工银美元债C

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)
2017. 1. 23-2017. 12. 31	-4.91%	0.18%	-2.71%	0.21%	-2.20%	-0.03%

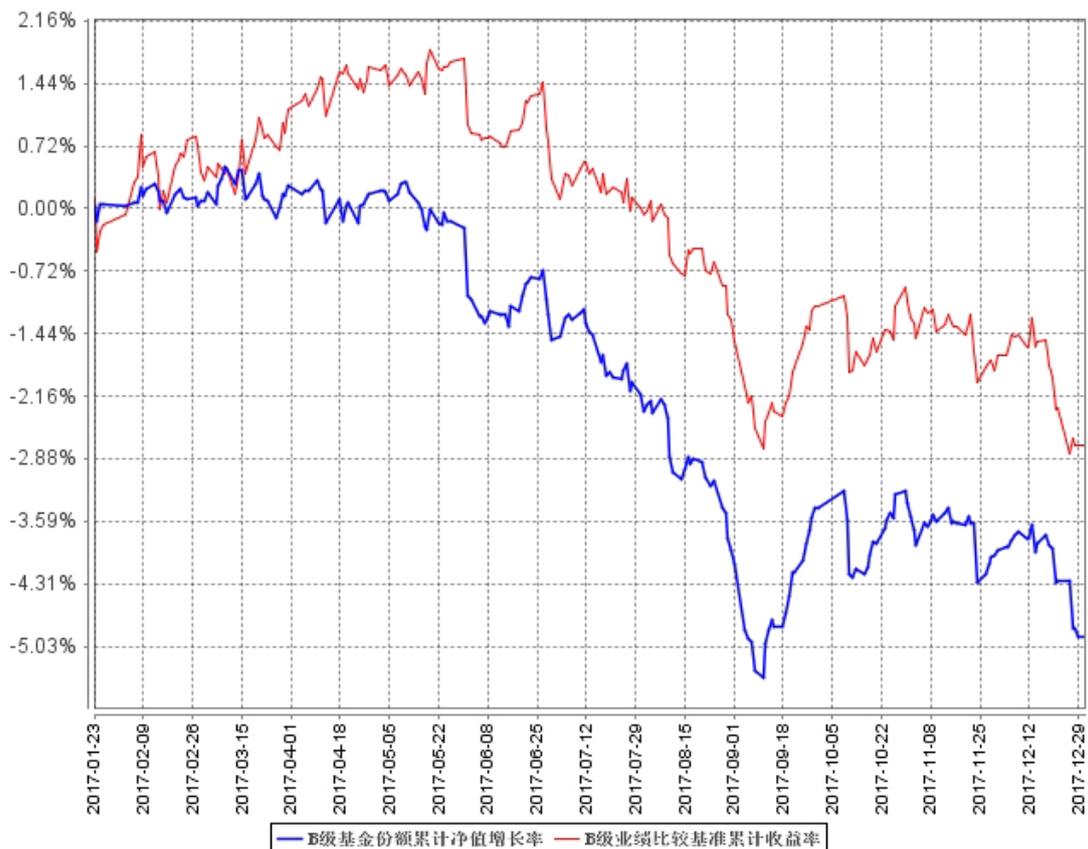
2、本基金合同生效以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较：

（2017年1月23日至2017年12月31日）

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2017年1月23日生效。截至报告期末，本基金基金合同生效不满一年。

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%。

### 十三、基金的费用与税收

#### （一）与基金运作有关的费用

##### 1. 基金费用的种类

- （1）基金管理人的管理费；
- （2）基金托管人的托管费（含境外托管人收取的费用）；
- （3）销售服务费；
- （4）《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- （5）《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费；
- （6）基金份额持有人大会费用；
- （7）基金的证券、期货账户开立费用、证券、期货交易费用及在境外市场的交易、清算、登记等实际发生的费用（out-of-pocket fees），包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、券商佣金的结算费及其他类似性质的费用等；
- （8）基金的银行汇划费用；
- （9）基金进行外汇兑换交易的相关费用；
- （10）基金依照有关法律法规应当缴纳的，购买或处置证券有关的任何税收、征费、关税、印花税、交易及其他税收及预扣提税（以及与前述各项有关的任何利息及费用及有关手续费、汇款费等）；
- （11）与基金缴纳税收有关的手续费、汇款费等；
- （12）代表基金投票或其他与基金投资活动有关的费用；
- （13）因基金运作需要或基金份额持有人决定更换基金管理人，更换基金托管人及基金资产由原基金托管人转移新基金托管人所引起的费用；
- （14）按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

##### 2. 基金费用计提方法、计提标准和支付方式

### （1）基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一估值日基金资产净值的 0.9% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.9\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一估值日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

### （2）基金托管人的托管费（含境外托管人收取的费用）

本基金的托管费按前一估值日基金资产净值的 0.22% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.22\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一估值日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

### （3）销售服务费

销售服务费可用于本基金市场推广、销售以及基金份额持有人服务等各项费用。本基金份额分为不同的类别，适用不同的销售服务费率。其中，A 类不收取销售服务费，C 类销售服务费年费率为 0.4%。C 类基金份额的销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times R \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一估值日基金资产净值

R 为 C 类别份额适用的销售服务费率

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金

支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

上述“（一）基金费用的种类中第4—14项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

### 3. 不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

（1）基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；

（2）基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

（3）《基金合同》生效前的相关费用；

（4）其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

### 4. 基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

### 5. 基金管理费和基金托管费的调整

在法律法规允许的条件下，基金管理人和基金托管人可协商酌情降低销售服务费，此项调整不需要基金份额持有人大会决议通过。基金管理人必须最迟于新的费率实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上刊登公告。

## （二）与基金销售有关的费用

### 1. 申购费

本基金对申购设置级差费率，投资者在一天之内如有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。本基金的具体申购费率结构如下表所示。

人民币份额	A类基金份额		C类基金份额
申购费率	M < 100 万元	0.80%	0%
	100 万元 ≤ M < 300 万元	0.50%	
	300 万元 ≤ M < 500 万元	0.30%	
	M ≥ 500 万元	按笔收取 1,000 元/笔	
美元份额	A类基金份额		
申购费率	M < 20 万美元	0.80%	
	20 万美元 ≤ M < 60 万美元	0.50%	
	60 万美元 ≤ M < 100 万美元	0.30%	
	M ≥ 100 万美元	按笔收取 200 美元/笔	

注：M为申购金额。

本基金 A 类份额的申购费用由申购人承担，主要用于本基金的市场推广、销售、登记等各项费用，不列入基金财产。

## 2、赎回费

赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。对持续持有期少于 30 日的投资人收取的赎回费将全额计入基金财产；对持续持有期不少于 30 日但少于 3 个月的投资人收取的赎回费总额的 75% 计入基金财产；对持续持有期不少于 3 个月但少于 6 个月的投资人收取的赎回费总额的 50% 计入基金财产；对持续持有期不少于 6 个月的投资人收取的赎回费总额的 25% 计入基金财产（1 年以 365 天计）。赎回费率随赎回基金份额持有期限的增加而递减，具体费率如下：

人民币份额	A 类基金份额		C 类基金份额	
赎回费率	持有期限	赎回费率	持有期限	赎回费率
	Y < 7 天	1.5%	Y < 7 天	1.50%
	7 天 ≤ Y < 30 天	0.75%	7 ≤ Y < 30 天	0.75%
	30 天 ≤ Y < 1 年	0.1%	Y ≥ 30 天	0%
	1 年 ≤ Y < 2 年	0.05%		
	Y ≥ 2 年	0%		
美元份额	A 类基金份额			
赎回费率	持有期限	赎回费率		
	Y < 7 天	1.5%		
	7 天 ≤ Y < 30 天	0.75%		
	30 天 ≤ Y < 1 年	0.1%		
	1 年 ≤ Y < 2 年	0.05%		
	Y ≥ 2 年	0%		

注：持有期限 Y，1 年指 365 天

3、赎回费用未计入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。

4、基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

5、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低基金申购费率。

6、本基金人民币份额的申购、赎回的币种为人民币，美元份额的申购、赎回币种为美元。基金管理人可以在不违反法律法规规定的情况下，设立以其它币种计价的基金份额以及接受其它币种的申购、赎回，其他外币基金份额申赎的原则、费用等届时由基金管理

人确定并提前公告。

7、在未来条件成熟时，本基金可以开通不同基金份额类别之间的转换，具体规则详见更新的招募说明书和相关公告。

#### 十四、对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人依据《基金法》、《运作办法》、《销售管理办法》、《信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求，对本基金招募说明书进行了更新，主要更新内容如下：

- 1、在“重要提示”部分，更新了招募说明书内容截止日及财务数据和净值表现数据截止日。
- 2、在“四、基金的投资”部分，更新了基金的最近一期的投资组合报告等信息。
- 3、在“五、基金的业绩”部分，更新了基金截至2017年12月31日的业绩表现情况。
- 4、在“六、基金管理人”部分，更新了基金管理人主要人员情况。
- 5、在“十七、基金托管人”部分，根据基金托管人提供的信息对相关内容进行了更新。
- 6、在“十八、境外资产托管人”部分，更新了基金境外资产托管人的相关信息。
- 7、在“十九、相关服务机构”部分，更新了基金份额发售机构的信息。
- 8、在“二十二、对基金份额持有人的服务”部分，更新了对持有人服务的相关信息。
- 9、在“二十三、其他应披露事项”部分，更新了本次更新期间的公告。

工银瑞信基金管理有限公司

二〇一八年三月八日