

# 工银瑞信全球美元债债券型证券投资基金 (QDII) 2020 年中期报告

2020 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：2020 年 8 月 28 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。本中期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 2020 年 8 月 26 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 2020 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

|                                         |           |
|-----------------------------------------|-----------|
| <b>§1 重要提示及目录</b>                       | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示                                | 2         |
| 1.2 目录                                  | 3         |
| <b>§2 基金简介</b>                          | <b>5</b>  |
| 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 境外投资顾问和境外资产托管人                      | 6         |
| 2.5 信息披露方式                              | 6         |
| 2.6 其他相关资料                              | 6         |
| <b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b>                 | <b>7</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 7         |
| 3.2 基金净值表现                              | 8         |
| 3.3 其他指标                                | 10        |
| <b>§4 管理人报告</b>                         | <b>10</b> |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 10        |
| 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             | 12        |
| 4.3 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明              | 12        |
| 4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 13        |
| 4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明             | 13        |
| 4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 14        |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 14        |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 14        |
| 4.9 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        |
| <b>§5 托管人报告</b>                         | <b>15</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明                  | 15        |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 15        |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见       | 15        |
| <b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>               | <b>15</b> |
| 6.1 资产负债表                               | 15        |
| 6.2 利润表                                 | 17        |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表                      | 18        |
| 6.4 报表附注                                | 19        |
| <b>§7 投资组合报告</b>                        | <b>43</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 43        |
| 7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布              | 44        |

|                                             |           |
|---------------------------------------------|-----------|
| 7.3 期末按行业分类的权益投资组合 .....                    | 44        |
| 7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细 .....     | 44        |
| 7.5 报告期内权益投资组合的重大变动 .....                   | 44        |
| 7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合 .....                | 45        |
| 7.7 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 .....    | 45        |
| 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细 ..... | 45        |
| 7.9 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 ..... | 45        |
| 7.10 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 .....   | 45        |
| 7.11 投资组合报告附注 .....                         | 46        |
| <b>§8 基金份额持有人信息 .....</b>                   | <b>46</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                 | 46        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....              | 47        |
| 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情况 .....      | 47        |
| <b>§9 开放式基金份额变动 .....</b>                   | <b>47</b> |
| <b>§10 重大事件揭示 .....</b>                     | <b>48</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                      | 48        |
| 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 .....      | 48        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....           | 48        |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                        | 48        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                 | 48        |
| 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 .....         | 49        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....                | 49        |
| 10.8 其他重大事件 .....                           | 52        |
| <b>§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>             | <b>52</b> |
| 11.1 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 .....    | 52        |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                   | 52        |
| <b>§12 备查文件目录 .....</b>                     | <b>52</b> |
| 12.1 备查文件目录 .....                           | 52        |
| 12.2 存放地点 .....                             | 53        |
| 12.3 查阅方式 .....                             | 53        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                          |                 |
|-----------------|--------------------------|-----------------|
| 基金名称            | 工银瑞信全球美元债债券型证券投资基金(QDII) |                 |
| 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          |                 |
| 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      | 114,230,409.51 份         |                 |
| 基金合同存续期         | 不定期                      |                 |
| 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 | 103,786,251.20 份         | 10,444,158.31 份 |

### 2.2 基金产品说明

|        |                                                                                                                                                                |
|--------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 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资产配置比例。 |
| 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。                                                                                                                 |

### 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                          | 李申                |
|         | 联系电话 | 400-811-9999                 | 021-60637102      |
|         | 电子邮箱 | customerservice@icbcs.com.cn | lishen.zh@ccb.com |

|        |                                                                                            |                       |
|--------|--------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------|
| 客户服务电话 | 400-811-9999                                                                               | 021-60637111          |
| 传真     | 010-66583158                                                                               | 021-60635778          |
| 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  | 王海璐                                                                                        | 田国立                   |

## 2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

| 项目   |    | 境外投资顾问 | 境外资产托管人                                                        |
|------|----|--------|----------------------------------------------------------------|
| 名称   | 英文 | —      | State Street Bank and Trust Company                            |
|      | 中文 | —      | 道富银行                                                           |
| 注册地址 |    | —      | One Lincoln Street, Boston, Massachusetts 02111, United States |
| 办公地址 |    | —      | One Lincoln Street, Boston, Massachusetts 02111, United States |
| 邮政编码 |    | —      | —                                                              |

注：本基金本报告期末聘请境外投资顾问。

## 2.5 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             |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | www.icbccs.com.cn |
| 基金中期报告备置地点          | 基金管理人或基金托管人的住所    |

## 2.6 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

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2020 年 1 月 1 日-2020 年 6 月 30 日) |               |
|---------------|-------------------------------------|---------------|
|               | 工银全球美元债 A 类                         | 工银全球美元债 C 类   |
| 本期已实现收益       | 2,858,972.82                        | 379,959.08    |
| 本期利润          | 3,495,733.04                        | 449,217.65    |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0362                              | 0.0343        |
| 本期加权平均净值利润率   | 3.30%                               | 3.16%         |
| 本期基金份额净值增长率   | 3.41%                               | 3.18%         |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2020 年 6 月 30 日)               |               |
| 期末可供分配利润      | 3,458,295.59                        | 254,687.19    |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0333                              | 0.0244        |
| 期末基金资产净值      | 116,122,788.67                      | 11,579,406.49 |
| 期末基金份额净值      | 1.1189                              | 1.1087        |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末(2020 年 6 月 30 日)               |               |
| 基金份额累计净值增长率   | 11.89%                              | 10.87%        |

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、期末可供分配利润，为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

4、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。

5、本基金基金合同生效日为 2017 年 1 月 23 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         | 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      | 0.09%    | 0.16%       | -0.26%     | 0.19%         | 0.35%  | -0.03% |
| 过去三个月      | 1.43%    | 0.21%       | 2.25%      | 0.23%         | -0.82% | -0.02% |
| 过去六个月      | 3.41%    | 0.25%       | 6.10%      | 0.29%         | -2.69% | -0.04% |
| 过去一年       | 6.34%    | 0.20%       | 9.69%      | 0.26%         | -3.35% | -0.06% |
| 过去三年       | 13.40%   | 0.23%       | 18.35%     | 0.26%         | -4.95% | -0.03% |
| 自基金合同生效起至今 | 11.89%   | 0.22%       | 18.77%     | 0.26%         | -6.88% | -0.04% |

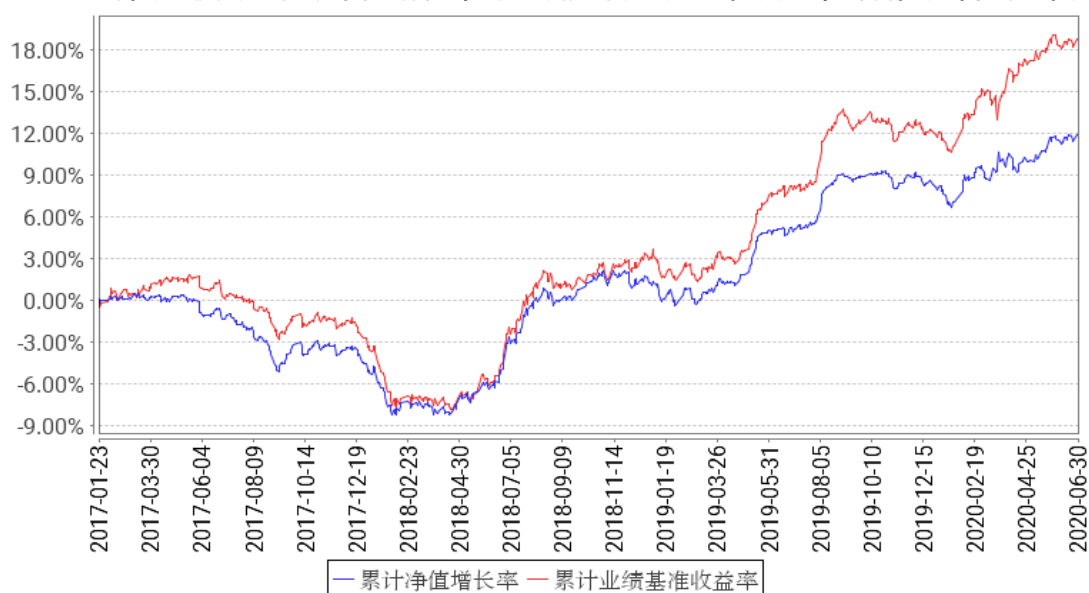
工银全球美元债 C 类

| 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 | 0.05%    | 0.16%       | -0.26%     | 0.19%         | 0.31%  | -0.03% |
| 过去三个月 | 1.31%    | 0.21%       | 2.25%      | 0.23%         | -0.94% | -0.02% |

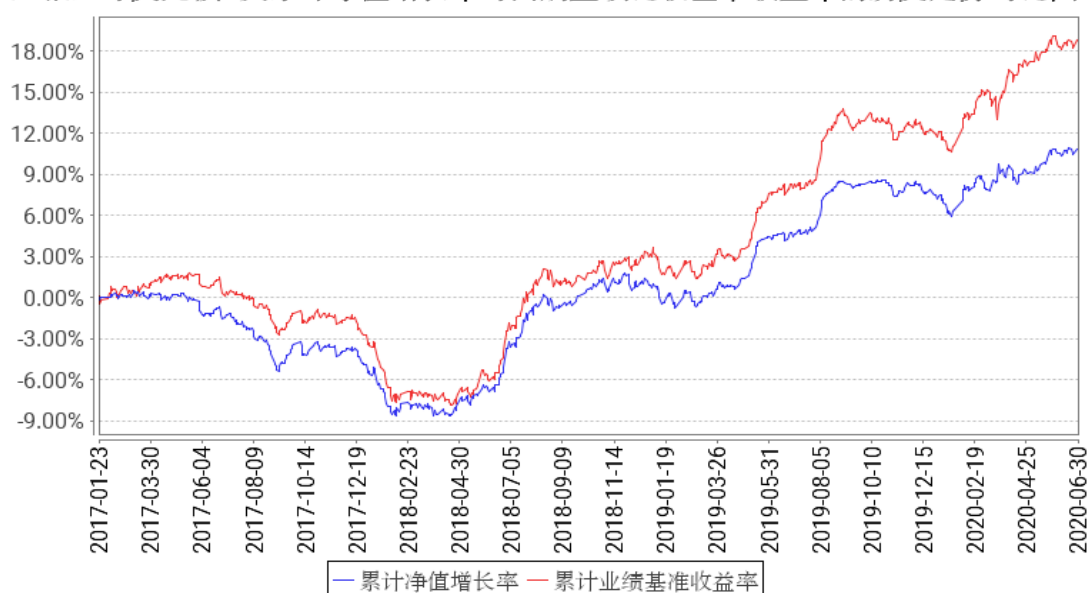
|            |        |       |        |       |        |        |
|------------|--------|-------|--------|-------|--------|--------|
| 过去六个月      | 3.18%  | 0.25% | 6.10%  | 0.29% | -2.92% | -0.04% |
| 过去一年       | 5.88%  | 0.20% | 9.69%  | 0.26% | -3.81% | -0.06% |
| 过去三年       | 12.57% | 0.23% | 18.35% | 0.26% | -5.78% | -0.03% |
| 自基金合同生效起至今 | 10.87% | 0.22% | 18.77% | 0.26% | -7.90% | -0.04% |

### 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

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。

### 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，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。公司目前在北京、上海、深圳设有分公司，在香港和上海设有全资子公司——工银瑞信资产管理（国际）有限公司、工银瑞信投资管理有限公司。

经过十多年的发展，工银瑞信(含子公司)已拥有公募基金、私募资产管理计划、企业年金、社保基金境内外委托投资、基本养老保险基金委托投资、保险资金委托投资、企业年金养老产品、

职业年金等多项产品管理人资格和 QDII、QFII、RQFII 等多项业务资格，成为国内业务资格全面、产品种类丰富、经营业绩优秀、资产管理规模领先、业务发展均衡的基金管理公司之一。

截至 2020 年 6 月 30 日，公司旗下管理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、工银瑞信中国机会全球配置股票型证券投资基金、工银瑞信沪深 300 指数证券投资基金、工银瑞信添颐债券型证券投资基金、工银瑞信金融地产行业混合型证券投资基金、工银瑞信医疗保健行业股票型证券投资基金、工银瑞信沪港深股票型证券投资基金、深证红利交易型开放式指数证券投资基金、工银瑞信上证 50 交易型开放式指数证券投资基金、工银瑞信沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、工银瑞信养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金（FOF）、工银瑞信科技创新 3 年封闭运作混合型证券投资基金、工银瑞信粤港澳大湾区创新 100 交易型开放式指数证券投资基金等逾 150 只公募基金。

公司始终坚持“以稳健的投资管理，为客户提供卓越的理财服务”为使命，依托强大的股东背景、稳健的经营理念、科学的投研体系、严密的风控机制和资深的管理团队，立足市场化、专业化、规范化和国际化，坚持“稳健投资、价值投资、长期投资”，致力于为广大投资者提供一流的投资管理服务。

#### 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<br>（助理）期限 |                    | 证券从<br>业年限 | 说明                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
|----|--------------|---------------------|--------------------|------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|    |              | 任职日期                | 离任日期               |            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| 刘琦 | 本基金的<br>基金经理 | 2017 年 1<br>月 23 日  | 2020 年 2<br>月 17 日 | 11 年       | 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 2019 年 6 月 6 日，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 2019 年 6 月 5 日，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 2019 年 10 月 22 日，担任工银瑞信中债国债（710 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；2018 年 9 月 21 日，担任工银瑞信聚福混合型证券投资基金基 |

|    |              |                    |   |     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
|----|--------------|--------------------|---|-----|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|    |              |                    |   |     | 金经理。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| 陈涵 | 本基金的<br>基金经理 | 2020 年 2<br>月 17 日 | - | 9 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；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。 |

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。

#### 4.1.3 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 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。

## 4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.4.1 公平交易制度的执行情况

本报告期，按照时间优先、价格优先的原则，本基金管理人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。

本基金管理人于每季度和年度对公司管理的不同投资组合进行了同向交易价差分析，采用了日内、3 日内、5 日内的时间窗口，假设不同组合间价差为零，进行了 T 分布检验。对于没有通过检验的交易，公司根据交易价格、交易频率、交易数量、交易时间进行了具体分析。经分析，本报告期未出现本基金管理人管理的不同投资组合间有同向交易价差异异常的情况。

### 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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2020 年上半年，新冠疫情对宏观经济产生了巨大的负面冲击。美元债前期对疫情的风险反应不足，至 3 月份疫情在全球爆发之后，市场对基本面的预期显著恶化，由于各种原因美元债市场流动性也显著下降，美元债市场在 3 月份大幅下挫，高收益债跌幅显著大于投资级债券。3 月末中下旬开始，美联储一方面加大对非金融企业的流动性支持，稳定基本面；另一方面通过多种工具投放美元流动性，缓解美元荒的问题。自此开始，美元债市场开始逐步回暖，特别是 2 季度以来，宏观经济的恢复速度整体超出预期，美元债出现了供需两旺的局面。

本基金在报告期内小幅提升了久期，同时积极调整持仓，降低资质偏弱债券的比重。

### 4.5.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，A 份额净值增长率为 3.41%，C 份额净值增长率为 3.18%，业绩比较基准收益率为 6.10%。

## 4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2 季度以来，宏观经济的恢复速度整体超出预期，其动力主要来自两方面：一是全球的经济刺激力度远超 08 年，政策刺激对经济的托底作用较大；二是国内经济在疫情得到有效控制的背景下，前期积压的需求逐步释放。展望未来，上述两个因素对经济的推动力量仍在，但边际上力度可能减弱。同时，海外疫情出现了进一步恶化，不排除进入秋冬季之后，疫情再度对经济造成冲击。目前美元债的利差仍处于历史中位数以上，但较前期已经出现明显收缩，利差对基本面潜在风险的保护有所减弱。尽管在均值回归的作用下，美元债利差可能会继续收窄，但在基本面动能边际弱化的背景下，收缩的空间相对有限。

## 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

（1）职责分工

估值小组成员为 4 人，分别来自公司运作部、固定收益部（或研究部）、风险管理部、法律合规部，组长由运作部负责人担任。

各部门负责人推荐各部门成员，如需更换，由相应部门负责人提出。小组成员需经运作部分管副总批准同意。

（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。

2、投资经理参与或决定估值的程度

投资经理可参与讨论估值原则和方法，但不得参与最终估值决策。

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、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。

## 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未实施利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

#### 4.9 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，本基金未实施利润分配。

#### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、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：工银瑞信全球美元债债券型证券投资基金(QDII)

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资 产   | 附注号     | 本期末<br>2020 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2019 年 12 月 31 日 |
|-------|---------|------------------------|--------------------------|
| 资 产：  |         |                        |                          |
| 银行存款  | 6.4.7.1 | 3,877,909.69           | 4,590,333.36             |
| 结算备付金 |         | -                      | -                        |

|                 |            |                                |                                  |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| 存出保证金           |            | -                              | -                                |
| 交易性金融资产         | 6.4.7.2    | 124,646,540.63                 | 115,923,331.22                   |
| 其中：股票投资         |            | -                              | -                                |
| 基金投资            |            | -                              | -                                |
| 债券投资            |            | 124,646,540.63                 | 115,923,331.22                   |
| 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         |            | -                              | 1,520,481.97                     |
| 应收利息            | 6.4.7.5    | 1,116,866.49                   | 1,226,473.72                     |
| 应收股利            |            | -                              | -                                |
| 应收申购款           |            | 964,210.93                     | 293,962.59                       |
| 递延所得税资产         |            | -                              | -                                |
| 其他资产            | 6.4.7.6    | -                              | -                                |
| 资产总计            |            | 130,605,527.74                 | 123,554,582.86                   |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2020 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2019 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负 债：</b>     |            |                                |                                  |
| 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       |            | -                              | -                                |
| 应付证券清算款         |            | -                              | -                                |
| 应付赎回款           |            | 2,685,049.16                   | 1,302,076.04                     |
| 应付管理人报酬         |            | 95,273.93                      | 94,767.91                        |
| 应付托管费           |            | 23,289.16                      | 23,165.47                        |
| 应付销售服务费         |            | 3,993.35                       | 6,912.98                         |
| 应付交易费用          | 6.4.7.7    | -                              | -                                |
| 应交税费            |            | 13,518.55                      | 12,294.25                        |
| 应付利息            |            | -                              | -                                |
| 应付利润            |            | -                              | -                                |
| 递延所得税负债         |            | -                              | -                                |
| 其他负债            | 6.4.7.8    | 82,208.43                      | 164,527.22                       |
| 负债合计            |            | 2,903,332.58                   | 1,603,743.87                     |
| <b>所有者权益：</b>   |            |                                |                                  |
| 实收基金            | 6.4.7.9    | 114,230,409.51                 | 112,828,834.61                   |
| 未分配利润           | 6.4.7.10   | 13,471,785.65                  | 9,122,004.38                     |
| 所有者权益合计         |            | 127,702,195.16                 | 121,950,838.99                   |
| 负债和所有者权益总计      |            | 130,605,527.74                 | 123,554,582.86                   |

注：1、本基金基金合同生效日为 2017 年 1 月 23 日。

2、报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额总额为 114,230,409.51 份，其中工银全球美元

债 A 类基金份额总额为 103,786,251.20 份, 基金份额净值 1.1189 元; 工银全球美元债 C 类基金份额总额为 10,444,158.31 份, 基金份额净值 1.1087 元。

## 6.2 利润表

会计主体: 工银瑞信全球美元债债券型证券投资基金(QDII)

本报告期: 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

| 项 目                    | 附注号        | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年<br>6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年<br>6 月 30 日 |
|------------------------|------------|------------------------------------------|-----------------------------------------------|
| 一、收入                   |            | 4,730,835.27                             | 4,548,366.50                                  |
| 1. 利息收入                |            | 2,166,915.38                             | 2,199,486.50                                  |
| 其中: 存款利息收入             | 6.4.7.11   | 13,366.38                                | 26,084.12                                     |
| 债券利息收入                 |            | 2,153,549.00                             | 2,173,402.38                                  |
| 资产支持证券利息收入             |            | -                                        | -                                             |
| 买入返售金融资产收入             |            | -                                        | -                                             |
| 证券出借利息收入               |            | -                                        | -                                             |
| 其他利息收入                 |            | -                                        | -                                             |
| 2. 投资收益(损失以“-”填列)      |            | 1,737,329.98                             | 448,460.55                                    |
| 其中: 股票投资收益             | 6.4.7.12   | -                                        | -                                             |
| 基金投资收益                 | 6.4.7.13   | -                                        | -                                             |
| 债券投资收益                 | 6.4.7.14   | 1,737,329.98                             | 448,460.55                                    |
| 资产支持证券投资               | 6.4.7.14.5 | -                                        | -                                             |
| 收益                     |            |                                          |                                               |
| 贵金属投资收益                | 6.4.7.15   | -                                        | -                                             |
| 衍生工具收益                 | 6.4.7.16   | -                                        | -                                             |
| 股利收益                   | 6.4.7.17   | -                                        | -                                             |
| 3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列) | 6.4.7.18   | 706,018.79                               | 1,898,819.22                                  |
| 4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)     |            | 69,919.09                                | -53,125.14                                    |
| 5. 其他收入(损失以“-”号填列)     | 6.4.7.19   | 50,652.03                                | 54,725.37                                     |
| 减: 二、费用                |            | 785,884.58                               | 805,652.91                                    |
| 1. 管理人报酬               | 6.4.10.2.1 | 535,496.78                               | 541,131.19                                    |
| 2. 托管费                 | 6.4.10.2.2 | 130,899.16                               | 132,276.45                                    |
| 3. 销售服务费               | 6.4.10.2.3 | 28,368.63                                | 42,277.34                                     |
| 4. 交易费用                | 6.4.7.20   | -                                        | -                                             |

|                     |          |              |              |
|---------------------|----------|--------------|--------------|
| 5. 利息支出             |          | -            | -            |
| 其中：卖出回购金融资产支出       |          | -            | -            |
| 6. 税金及附加            |          | 7,752.87     | 7,824.35     |
| 7. 其他费用             | 6.4.7.21 | 83,367.14    | 82,143.58    |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） |          | 3,944,950.69 | 3,742,713.59 |
| 减：所得税费用             |          | -            | -            |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）   |          | 3,944,950.69 | 3,742,713.59 |

注：本基金基金合同生效日为 2017 年 1 月 23 日。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：工银瑞信全球美元债债券型证券投资基金(QDII)

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 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）                        | 112,828,834.61                        | 9,122,004.38  | 121,950,838.99 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）              | -                                     | 3,944,950.69  | 3,944,950.69   |
| 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）      | 1,401,574.90                          | 404,830.58    | 1,806,405.48   |
| 其中：1. 基金申购款                            | 61,807,416.27                         | 6,092,662.03  | 67,900,078.30  |
| 2. 基金赎回款                               | -60,405,841.37                        | -5,687,831.45 | -66,093,672.82 |
| 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） | -                                     | -             | -              |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 114,230,409.51                        | 13,471,785.65 | 127,702,195.16 |

| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 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)                        | 147,829,631.72                             | 1,837,982.12  | 149,667,613.84 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)              | -                                          | 3,742,713.59  | 3,742,713.59   |
| 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)      | -36,407,592.13                             | 110,805.04    | -36,296,787.09 |
| 其中：1. 基金申购款                            | 50,709,840.59                              | 1,179,199.51  | 51,889,040.10  |
| 2. 基金赎回款                               | -87,117,432.72                             | -1,068,394.47 | -88,185,827.19 |
| 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) | -                                          | -             | -              |
| 五、期末所有者权益(基金净值)                        | 111,422,039.59                             | 5,691,500.75  | 117,113,540.34 |

注：本基金基金合同生效日为 2017 年 1 月 23 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：

王海璐

赵紫英

关亚君

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

工银瑞信全球美元债债券型证券投资基金(QDII) (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[2016]2019 号《关于准予工银瑞信全球美元债债券型证券投资基金(QDII) 注册的批复》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《工银瑞信全球美元债债券型证券投资基金(QDII) 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人民币 116,868,997.28 元和美元 17,013,784.75 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2017)第 024 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《工银瑞信全球美元债债券型证券投资基金(QDII)基金合同》于 2017 年 1 月 23 日正式生效，基金合同生效日本基金人民币份额为 116,891,771.25 份，美元份额为 116,613,370.65 份，其中认购资金利息折合人民币份额 22,773.97 份，美元份额 726.49 份。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”)，境外资产托管人为道富银行 State Street Bank and Trust Company(以下简称“道富银行”)。

根据《工银瑞信全球美元债债券型证券投资基金(QDII)基金合同》和《工银瑞信全球美元债债券型证券投资基金(QDII)招募说明书》并报中国证监会备案，本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取前端认购/申购费，而不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 A 类；不收取前后端认购/申购费，而从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类。在每一份额类别内，根据认购、申购、赎回计价币种的不同，分为人民币份额和美元份额。本基金 C 类份额目前暂不开通美元份额，将来若开通 C 类美元份额的销售，基金管理人将另行公告。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《工银瑞信全球美元债债券型证券投资基金(QDII)基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为包括政府债券、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。基金的投资组合比例为：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。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。

#### 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<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《工银瑞信全球美元债债券型证券投资基金(QDII)基金合同》和其他中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 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2020年6月30日的财务状况以及2020年上半年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

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、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政策的补充通知》、财税

[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 目前基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收企业所得税

(3) 目前基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

(4) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 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<br>2020 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 3,877,909.69           |
| 定期存款           | —                      |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | —                      |
| 存款期限 1-3 个月    | —                      |
| 存款期限 3 个月以上    | —                      |
| 其他存款           | —                      |
| 合计             | 3,877,909.69           |

## 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            |       | 本期末<br>2020 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 | 118,934,206.77         | 124,646,540.63 | 5,712,333.86 |
|               | 银行间市场 | -                      | -              | -            |
|               | 合计    | 118,934,206.77         | 124,646,540.63 | 5,712,333.86 |
| 资产支持证券        |       | -                      | -              | -            |
| 基金            |       | -                      | -              | -            |
| 其他            |       | -                      | -              | -            |
| 合计            |       | 118,934,206.77         | 124,646,540.63 | 5,712,333.86 |

## 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

## 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

无。

## 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

## 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2020 年 6 月 30 日 |
|------------|------------------------|
| 应收活期存款利息   | 531.13                 |
| 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  | -                      |
| 应收债券利息     | 1,116,335.36           |
| 应收资产支持证券利息 | -                      |
| 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 | -            |
| 应收出借证券利息   | -            |
| 其他         | -            |
| 合计         | 1,116,866.49 |

#### 6.4.7.6 其他资产

无。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

无。

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2020 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                      |
| 应付赎回费       | 656.05                 |
| 应付证券出借违约金   | -                      |
| 预提审计费       | 21,880.04              |
| 预提信息披露费     | 59,672.34              |
| 合计          | 82,208.43              |

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

##### 工银全球美元债 A 类

| 项目            | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |                |
|---------------|---------------------------------------|----------------|
|               | 基金份额（份）                               | 账面金额           |
| 上年度末          | 95,559,122.44                         | 95,559,122.44  |
| 本期申购          | 47,857,740.07                         | 47,857,740.07  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -39,630,611.31                        | -39,630,611.31 |
| -基金拆分/份额折算前   | -                                     | -              |
| 基金拆分/份额折算调整   | -                                     | -              |
| 本期申购          | -                                     | -              |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -                                     | -              |
| 本期末           | 103,786,251.20                        | 103,786,251.20 |

##### 工银全球美元债 C 类

| 项目   | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |               |
|------|---------------------------------------|---------------|
|      | 基金份额（份）                               | 账面金额          |
| 上年度末 | 17,269,712.17                         | 17,269,712.17 |
| 本期申购 | 13,949,676.20                         | 13,949,676.20 |

|               |                |                |
|---------------|----------------|----------------|
| 本期赎回（以“-”号填列） | -20,775,230.06 | -20,775,230.06 |
| -基金拆分/份额折算前   | -              | -              |
| 基金拆分/份额折算调整   | -              | -              |
| 本期申购          | -              | -              |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -              | -              |
| 本期末           | 10,444,158.31  | 10,444,158.31  |

注：若本基金有分红及转换业务，申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 工银全球美元债 A 类            |              |               |               |
|------------------------|--------------|---------------|---------------|
| 项目                     | 已实现部分        | 未实现部分         | 未分配利润合计       |
| 上年度末                   | 307,553.64   | 7,527,417.89  | 7,834,971.53  |
| 本期利润                   | 2,858,972.82 | 636,760.22    | 3,495,733.04  |
| 本期基金份额<br>交易产生的变<br>动数 | 291,769.13   | 714,063.77    | 1,005,832.90  |
| 其中：基金申<br>购款           | 1,147,912.43 | 3,668,006.88  | 4,815,919.31  |
| 基金赎<br>回款              | -856,143.30  | -2,953,943.11 | -3,810,086.41 |
| 本期已分配利<br>润            | -            | -             | -             |
| 本期末                    | 3,458,295.59 | 8,878,241.88  | 12,336,537.47 |
| 工银全球美元债 C 类            |              |               |               |
| 项目                     | 已实现部分        | 未实现部分         | 未分配利润合计       |
| 上年度末                   | -56,964.31   | 1,343,997.16  | 1,287,032.85  |
| 本期利润                   | 379,959.08   | 69,258.57     | 449,217.65    |
| 本期基金份额<br>交易产生的变<br>动数 | -68,307.58   | -532,694.74   | -601,002.32   |
| 其中：基金申<br>购款           | 196,361.72   | 1,080,381.00  | 1,276,742.72  |
| 基金赎<br>回款              | -264,669.30  | -1,613,075.74 | -1,877,745.04 |
| 本期已分配利<br>润            | -            | -             | -             |
| 本期末                    | 254,687.19   | 880,560.99    | 1,135,248.18  |

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |
|----|---------------------------------------|
|----|---------------------------------------|

|           |           |
|-----------|-----------|
| 活期存款利息收入  | 13,366.26 |
| 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 | 0.12      |
| 其他        | -         |
| 合计        | 13,366.38 |

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

无。

##### 6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

无。

##### 6.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

#### 6.4.7.13 基金投资收益

无。

#### 6.4.7.14 债券投资收益

##### 6.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                            | 本期<br>2020年1月1日至2020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 | 1,737,329.98               |
| 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                            | 1,737,329.98               |

## 6.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                      | 本期<br>2020年1月1日至2020年6月30日 |
|-------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额   | 43,712,363.67              |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 41,541,334.91              |
| 减：应收利息总额                | 433,698.78                 |
| 买卖债券差价收入                | 1,737,329.98               |

## 6.4.7.14.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

## 6.4.7.14.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

## 6.4.7.14.5 资产支持证券投资收益

无。

## 6.4.7.15 贵金属投资收益

## 6.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成

无。

## 6.4.7.15.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

## 6.4.7.15.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

## 6.4.7.15.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

## 6.4.7.16 衍生工具收益

## 6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

## 6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

## 6.4.7.17 股利收益

无。

## 6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称                       | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |
|----------------------------|---------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产                 | 706,018.79                            |
| 股票投资                       | -                                     |
| 债券投资                       | 706,018.79                            |
| 资产支持证券投资                   | -                                     |
| 基金投资                       | -                                     |
| 贵金属投资                      | -                                     |
| 其他                         | -                                     |
| 2. 衍生工具                    | -                                     |
| 权证投资                       | -                                     |
| 3. 其他                      | -                                     |
| 减：应税金融商品公允价值变动<br>产生的预估增值税 | -                                     |
| 合计                         | 706,018.79                            |

## 6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 50,652.03                             |

|    |           |
|----|-----------|
| 合计 | 50,652.03 |
|----|-----------|

#### 6.4.7.20 交易费用

无。

#### 6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------|
| 审计费用    | 21,880.04                             |
| 信息披露费   | 59,672.34                             |
| 证券出借违约金 | —                                     |
| 账户维护费   | 360.00                                |
| 银行费用    | 1,454.76                              |
| 合计      | 83,367.14                             |

#### 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          |
| 道富银行         | 境外资产托管人               |
| 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：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

## 6.4.10.1.1 股票交易

无。

## 6.4.10.1.2 债券交易

无。

## 6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

## 6.4.10.1.4 基金交易

无。

## 6.4.10.1.5 权证交易

无。

## 6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

无。

## 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<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6<br>月 30 日 | 上年度可比期间<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年<br>6 月 30 日 |
|-----------------|------------------------------------------|-----------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 535,496.78                               | 541,131.19                                    |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 206,700.33                               | 195,058.59                                    |

注：1、基金管理费按前一估值日的基金资产净值的 0.9%的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.9\% / \text{当年天数}$$

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

2、基金管理人的管理费每日计提，按月支付。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 |
|----------------|---------------------------------------|--------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 130,899.16                            | 132,276.45                                 |

注：1、基金托管费按前一估值日的基金资产净值的 0.22% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.22\% / \text{当年天数}$$

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

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<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日      |             |          |
|----------------|--------------------------------------------|-------------|----------|
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                           |             |          |
|                | 工银全球美元债 A 类                                | 工银全球美元债 C 类 | 合计       |
| 工银瑞信基金管理有限公司   | —                                          | 20.20       | 20.20    |
| 中国工商银行股份有限公司   | —                                          | 5,863.98    | 5,863.98 |
| 中国建设银行股份有限公司   | —                                          | 2,282.77    | 2,282.77 |
| 合计             | —                                          | 8,166.95    | 8,166.95 |
| 获得销售服务费的各关联方   | 上年度可比期间<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 |             |          |

| 方名称          | 当期发生的基金应支付的销售服务费 |             |           |
|--------------|------------------|-------------|-----------|
|              | 工银全球美元债 A 类      | 工银全球美元债 C 类 | 合计        |
| 工银瑞信基金管理有限公司 | —                | 11,561.52   | 11,561.52 |
| 中国工商银行股份有限公司 | —                | 10,330.11   | 10,330.11 |
| 中国建设银行股份有限公司 | —                | 1,460.79    | 1,460.79  |
| 合计           | —                | 23,352.42   | 23,352.42 |

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额前一估值日的基金资产净值的 0.4% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.4\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金销售服务费

E 为 C 类基金份额前一估值日的基金资产净值

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

无。

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

##### 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

## 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

## 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

## 6.4.10.5.2 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

无。

## 6.4.10.6 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<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |           | 上年度可比期间<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 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    |
| 道富银行         | 771,393.79                            | 1,269.79  | 10,362,953.37                              | 11,313.49 |
| 中国建设银行股份有限公司 | 3,106,515.90                          | 12,096.47 | 6,961,951.74                               | 14,770.63 |

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、本基金的活期银行存款分别由基金托管人中国建设银行和基金境外资产托管人道富银行保管，按适用利率或约定利率计息。

## 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

## 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

## 6.4.11 利润分配情况

无。

## 6.4.12 期末(2020 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

无。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

#### 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

无。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

### 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

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人的风险管理机构由董事会下属的公司治理与风险控制委员会、督察长、公司风险管理委员会、法律合规部、风险管理部、内控稽核部以及各个业务部门组成。

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，负责根据公司经营计划、业务规则以及自身情况制订本部门的制度流程以及风险控制措施，同时分别在自己的授权范围内对关联部门及岗位进行监督并承担相应的责任；各部门设置兼职或专职合规管理人员，对本部门执行法律法规、监管要求及公司规章制度的情况进行监督。第二道防线由公司专属风险管理部门法律合规部、风险管理部和内控稽核部构成，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业务的投资风险进行监控管理，内控稽核部对业务的风险和合规性以及制度执行情况进行监督检查。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同责任，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，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金持有同一机构（政府、国际金融组织除外）发行的证券市值不得超过基金资产净值的 10%。本基金投资于远期合约、互换等柜台交易金融衍生品时，要求所有参与交易对手方（中资商业银行除外）应当具有不低于中国证监会认可的信用评级机构评级，并且任一交易对手方的市值计价敞口不得超过基金资产净值的 20%。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级的债券投资。

##### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级的资产支持证券投资。

##### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级的同业存单投资。

## 6.4.13.2.4 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<br>2020 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2019 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| AAA    | —                      | —                        |
| AAA 以下 | 48,004,878.91          | 47,361,621.31            |
| 未评级    | 76,641,661.72          | 68,561,709.91            |
| 合计     | 124,646,540.63         | 115,923,331.22           |

注：1、表中所列示的债券投资为除短期融资券、同业存单、资产支持证券以外的信用债券。

2、上述评级采用国际权威机构穆迪发布的债券评级。

## 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级的资产支持证券投资。

## 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级的同业存单投资。

## 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、信誉良好的美元债券等，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。

## 6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内

部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 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

利率风险是指基金的财务状况和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。本基金主要投资于债券市场，因此本基金的收入及经营活动的现金流量受到市场利率变化的影响。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。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。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2020年6月30<br>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                  | 3,877,909.69 |       |               |               |               |     | 3,877,909.69   |
| 结算备付金                 | -            |       |               |               |               |     | -              |
| 存出保证金                 |              |       |               |               |               |     | -              |
| 交易性金融资产               | -            |       | 22,711,963.41 | 72,663,655.28 | 29,270,921.94 |     | 124,646,540.63 |
| 衍生金融资产                |              |       |               |               |               | -   | -              |
| 买入返售金融资产              |              |       |               |               |               |     | -              |

|                          |              |        |               |               |               |              |                |
|--------------------------|--------------|--------|---------------|---------------|---------------|--------------|----------------|
| 应收证券清算款                  |              |        |               |               |               | -            | -              |
| 应收利息                     |              |        |               |               |               | 1,116,866.49 | 1,116,866.49   |
| 应收股利                     |              |        |               |               |               | -            | -              |
| 应收申购款                    | -            |        |               |               |               | 964,210.93   | 964,210.93     |
| 递延所得税资产                  |              |        |               |               |               |              | -              |
| 其他资产                     |              |        |               |               |               | -            | -              |
| 资产总计                     | 3,877,909.69 | -      | 22,711,963.41 | 72,663,655.28 | 29,270,921.94 | 2,081,077.42 | 130,605,527.74 |
| 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                |              |        |               |               |               |              | -              |
| 应付证券清算款                  |              |        |               |               |               | -            | -              |
| 应付赎回款                    |              |        |               |               |               | 2,685,049.16 | 2,685,049.16   |
| 应付管理人报酬                  |              |        |               |               |               | 95,273.93    | 95,273.93      |
| 应付托管费                    |              |        |               |               |               | 23,289.16    | 23,289.16      |
| 应付销售服务费                  |              |        |               |               |               | 3,993.35     | 3,993.35       |
| 应付交易费用                   |              |        |               |               |               |              | -              |
| 应交税费                     |              |        |               |               |               | 13,518.55    | 13,518.55      |
| 应付利息                     |              |        |               |               |               |              | -              |
| 应付利润                     |              |        |               |               |               |              | -              |
| 递延所得税负债                  |              |        |               |               |               |              | -              |
| 其他负债                     |              |        |               |               |               | 82,208.43    | 82,208.43      |
| 负债总计                     | -            | -      | -             | -             | -             | 2,903,332.58 | 2,903,332.58   |
| 利率敏感度缺口                  | 3,877,909.69 | -      | 22,711,963.41 | 72,663,655.28 | 29,270,921.94 | -822,255.16  | 127,702,195.16 |
| 上年度末<br>2019 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                     | 4,590,333.3  | -      | -             | -             | -             | -            | 4,590,333.     |

|           |              |               |               |               |              |                |                |
|-----------|--------------|---------------|---------------|---------------|--------------|----------------|----------------|
|           | 6            |               |               |               |              |                | 36             |
| 结算备付金     | -            | -             | -             | -             | -            | -              | -              |
| 存出保证金     | -            | -             | -             | -             | -            | -              | -              |
| 交易性金融资产   | 8,305,086.57 | 27,984,168.23 | 75,972,715.52 | 3,661,360.90  | -            | 115,923,331.22 | -              |
| 衍生金融资产    | -            | -             | -             | -             | -            | -              | -              |
| 买入返售金融资产  | -            | -             | -             | -             | -            | -              | -              |
| 应收证券清算款   | -            | -             | -             | -             | -            | 1,520,481.97   | 1,520,481.97   |
| 应收利息      | -            | -             | -             | -             | -            | 1,226,473.72   | 1,226,473.72   |
| 应收股利      | -            | -             | -             | -             | -            | -              | -              |
| 应收申购款     | -            | -             | -             | -             | -            | 293,962.59     | 293,962.59     |
| 递延所得税资产   | -            | -             | -             | -             | -            | -              | -              |
| 其他资产      | -            | -             | -             | -             | -            | -              | -              |
| 资产总计      | 4,590,333.36 | 8,305,086.57  | 27,984,168.23 | 75,972,715.52 | 3,661,360.90 | 3,040,918.28   | 123,554,582.86 |
| 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 | -            | -             | -             | -             | -            | -              | -              |
| 应付证券清算款   | -            | -             | -             | -             | -            | -              | -              |
| 应付赎回款     | -            | -             | -             | -             | -            | 1,302,076.04   | 1,302,076.04   |
| 应付管理人报酬   | -            | -             | -             | -             | -            | 94,767.91      | 94,767.91      |
| 应付托管费     | -            | -             | -             | -             | -            | 23,165.47      | 23,165.47      |
| 应付销售服务费   | -            | -             | -             | -             | -            | 6,912.98       | 6,912.98       |
| 应付交易费用    | -            | -             | -             | -             | -            | -              | -              |
| 应交税费      | -            | -             | -             | -             | -            | 12,294.25      | 12,294.25      |
| 应付利息      | -            | -             | -             | -             | -            | -              | -              |
| 应付利润      | -            | -             | -             | -             | -            | -              | -              |
| 递延所得税负债   | -            | -             | -             | -             | -            | -              | -              |
| 其他负债      | -            | -             | -             | -             | -            | 164,527.22     | 164,527.22     |

|         |              |              |               |               |              |              |                |
|---------|--------------|--------------|---------------|---------------|--------------|--------------|----------------|
| 负债总计    | -            | -            | -             | -             | -            | 1,603,743.87 | 1,603,743.87   |
| 利率敏感度缺口 | 4,590,333.36 | 8,305,086.57 | 27,984,168.23 | 75,972,715.52 | 3,661,360.90 | 1,437,174.41 | 121,950,838.99 |

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。  |                             |                        |
|    | 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（2020 年 6 月 30 日）        | 上年度末（2019 年 12 月 31 日） |
| 分析 | 利率减少 25 基准点                      | 579,536.30                  | 423,134.65             |
|    | 利率增加 25 基准点                      | -579,676.53                 | -423,105.67            |

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

| 项目       | 本期末<br>2020 年 6 月 30 日 |              |                |                |
|----------|------------------------|--------------|----------------|----------------|
|          | 美元<br>折合人民币元           | 港币<br>折合人民币元 | 其他币种<br>折合人民币元 | 合计             |
| 以外币计价的资产 |                        |              |                |                |
| 银行存款     | 1,547,938.34           |              |                | 1,547,938.34   |
| 交易性金融资产  | 124,646,540.63         |              |                | 124,646,540.63 |
| 应收利息     | 1,116,348.81           |              |                | 1,116,348.81   |

|                       |                          |              |                |                |
|-----------------------|--------------------------|--------------|----------------|----------------|
| 应收申购款                 | 459,935.15               |              |                | 459,935.15     |
| 资产合计                  | 127,770,762.93           |              |                | 127,770,762.93 |
| 以外币计价的<br>负债          |                          |              |                |                |
| 应付赎回款                 | 598,011.67               |              |                | 598,011.67     |
| 应付赎回费                 | 363.11                   |              |                | 363.11         |
| 负债合计                  | 598,374.78               |              |                | 598,374.78     |
| 资产负债表外<br>汇风险敞口净<br>额 | 127,172,388.15           |              |                | 127,172,388.15 |
| 项目                    | 上年度末<br>2019 年 12 月 31 日 |              |                |                |
|                       | 美元<br>折合人民币元             | 港币<br>折合人民币元 | 其他币种<br>折合人民币元 | 合计             |
| 以外币计价的<br>资产          |                          |              |                |                |
| 银行存款                  | 3,696,252.65             |              |                | 3,696,252.65   |
| 交易性金融资<br>产           | 115,923,331.22           |              |                | 115,923,331.22 |
| 应收证券清算<br>款           | 1,520,481.97             |              |                | 1,520,481.97   |
| 应收利息                  | 1,226,049.53             |              |                | 1,226,049.53   |
| 应收申购款                 | 159,190.19               |              |                | 159,190.19     |
| 资产合计                  | 122,525,305.56           |              |                | 122,525,305.56 |
| 以外币计价的<br>负债          |                          |              |                |                |
| 应付赎回款                 | 215,467.61               |              |                | 215,467.61     |
| 应付赎回费                 | 107.01                   |              |                | 107.01         |
| 负债合计                  | 215,574.62               |              |                | 215,574.62     |
| 资产负债表外<br>汇风险敞口净<br>额 | 122,309,730.94           |              |                | 122,309,730.94 |

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

|    |                                                                 |                |  |
|----|-----------------------------------------------------------------|----------------|--|
| 假设 | 除本基金的单一外币汇率变化 5%以外的其他市场变量保持不变,且未考虑基金管理人<br>为降低汇率风险而可能采取的风险管理活动。 |                |  |
|    | 相关风险变量的变                                                        | 对资产负债表日基金资产净值的 |  |

|    | 动            | 影响金额（单位：人民币元）        |                        |
|----|--------------|----------------------|------------------------|
|    |              | 本期末（2020 年 6 月 30 日） | 上年度末（2019 年 12 月 31 日） |
| 分析 | 美元相对人民币升值 5% | 6,358,619.41         | 6,115,486.55           |
|    | 美元相对人民币贬值 5% | -6,358,619.41        | -6,115,486.55          |

注：1、表中列示了当年以外币计价的资产中前五大币种的汇率变动对基金资产净值的影响。

2、标记“-”处，表示当年该币种的汇率风险较小。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场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，不主动参与股票等权益类资产的投资。本基金所面临的最大的市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

#### 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<br>2020 年 6 月 30 日 |               | 上年度末<br>2019 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  | 124,646,540.63         | 97.61         | 115,923,331.22           | 95.06         |
| 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          | 124,646,540.63 | 97.61 | 115,923,331.22 | 95.06 |

注：1、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%。

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

本基金本报告期末及上年度末主要投资于债券，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

无。

## § 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：普通股  | —              | —             |
|    | 存托凭证    | —              | —             |
|    | 优先股     | —              | —             |
|    | 房地产信托凭证 | —              | —             |
| 2  | 基金投资    | —              | —             |
| 3  | 固定收益投资  | 124,646,540.63 | 95.44         |
|    | 其中：债券   | 124,646,540.63 | 95.44         |
|    | 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      | 3,877,909.69   | 2.97   |
| 8 | 其他各项资产            | 2,081,077.42   | 1.59   |
| 9 | 合计                | 130,605,527.74 | 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 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

本基金本报告期末未持有权益投资。

## 7.3 期末按行业分类的权益投资组合

本基金本报告期末未持有权益投资。

## 7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

本基金本报告期末未持有权益投资。

## 7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

### 7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

本基金本报告期末未持有权益投资。

### 7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

本基金本报告期末未持有权益投资。

### 7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

本基金本报告期末未持有权益投资。

## 7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 债券信用等级      | 公允价值          | 占基金资产净值比例 (%) |
|-------------|---------------|---------------|
| Aa1 至 Aa3   | -             | -             |
| A1 至 A3     | 18,185,508.10 | 14.24         |
| Baa1 至 Baa3 | 29,819,370.81 | 23.35         |
| 未评级         | 76,641,661.72 | 60.02         |

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。

## 7.7 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码         | 债券名称                     | 数量        | 公允价值         | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|--------------|--------------------------|-----------|--------------|---------------|
| 1  | XS1508782098 | BCDHGR 3 3/8<br>11/03/21 | 7,433,475 | 7,435,110.36 | 5.82          |
| 2  | US06428YAA47 | BOCHKL 5.9<br>PERP       | 5,663,600 | 6,056,030.84 | 4.74          |
| 3  | XS1900974558 | SCCIGC 4 3/4<br>11/21/21 | 5,663,600 | 5,813,798.67 | 4.55          |
| 4  | XS1912611354 | YUNAEN 6 1/4<br>11/29/21 | 5,663,600 | 5,785,537.31 | 4.53          |
| 5  | XS1301292261 | SDBC 2 1/2<br>10/09/20   | 5,663,600 | 5,686,537.58 | 4.45          |

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。

## 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

## 7.9 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。

## 7.10 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。

## 7.11 投资组合报告附注

### 7.11.1 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。

### 7.11.2 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。

### 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   | —            |
| 2  | 应收证券清算款 | —            |
| 3  | 应收股利    | —            |
| 4  | 应收利息    | 1,116,866.49 |
| 5  | 应收申购款   | 964,210.93   |
| 6  | 其他应收款   | —            |
| 7  | 待摊费用    | —            |
| 8  | 其他      | —            |
| 9  | 合计      | 2,081,077.42 |

### 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处于转股期的可转换债券。

### 7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

### 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   | 2,246    | 46,209.37 | 22,646,547.57 | 21.82     | 81,139,703.63 | 78.18     |

|             |       |           |               |       |               |        |
|-------------|-------|-----------|---------------|-------|---------------|--------|
| 全球美元债 A 类   |       |           |               |       |               |        |
| 工银全球美元债 C 类 | 979   | 10,668.19 | -             | -     | 10,444,158.31 | 100.00 |
| 合计          | 3,225 | 35,420.28 | 22,646,547.57 | 19.83 | 91,583,861.94 | 80.17  |

## 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 | 工银全球美元债 A 类 | 4,768.02  | 0.0         |
|                  | 工银全球美元债 C 类 | 13,743.34 | 0.13        |
|                  | 合计          | 18,511.36 | 0.02        |

## 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情况

无。

## § 9 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   |
|----------------------------------------|----------------|---------------|
| 基金合同生效日<br>(2017 年 1 月 23 日)<br>基金份额总额 | 211,109,012.86 | 22,396,129.04 |
| 本报告期期初基金份额总额                           | 95,559,122.44  | 17,269,712.17 |
| 本报告期基金总申购份额                            | 47,857,740.07  | 13,949,676.20 |

|                          |                |               |
|--------------------------|----------------|---------------|
| 减：本报告期基金总赎回份额            | 39,630,611.31  | 20,775,230.06 |
| 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             | 103,786,251.20 | 10,444,158.31 |

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 2020 年 2 月 22 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》，马成先生自 2020 年 2 月 21 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：

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 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，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

## 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 |    |
| Zhongtai International                          | —      | —    | —            | —         | —          | —  |
| Mizuho Securities                               | —      | —    | —            | —         | —          | —  |
| Australia and New Zealand Banking Group Limited | —      | —    | —            | —         | —          | —  |
| Citigroup                                       | —      | —    | —            | —         | —          | —  |
| Bank of Ningbo                                  | —      | —    | —            | —         | —          | —  |
| Guotai Junan Securities HK                      | —      | —    | —            | —         | —          | —  |
| CSI Global Markets Limited                      | —      | —    | —            | —         | —          | —  |
| Bank of                                         | —      | —    | —            | —         | —          | —  |

|                                         |   |   |   |   |   |   |
|-----------------------------------------|---|---|---|---|---|---|
| China International                     |   |   |   |   |   |   |
| Goldman Sachs                           | - | - | - | - | - | - |
| China International Capital Corporation | - | - | - | - | - | - |
| Deutsche Bank Sec                       | - | - | - | - | - | - |
| Morgan Stanley                          | - | - | - | - | - | - |
| Haitong International Securities        | - | - | - | - | - | - |
| 长江证券                                    | 1 | - | - | - | - | - |

注：交易单元的选择标准和程序：为保障公司境外证券投资的顺利开展，基金管理人选择综合实力强、研究能力突出、合规经营的证券经营机构，向其租用专用交易单元。

（1）选择标准：

- a) 经营行为规范，在最近一年内无重大违规行为。
- b) 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、个股分析报告及量化、衍生品和国际市场的研究服务支持。
- c) 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯服务。
- d) 与其他证券经营机构相比，能够提供最佳交易执行和优惠合理的佣金费率。

（2）选择程序

- a) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易账户的证券经营机构。
- b) 基金管理人与所选定的证券经营机构办理开立账户事宜，并通知基金托管人。

## 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 |                          | 基金交易 |                      |
|-------------------------------------------------|---------------|--------------------------|--------|----------------------------|------|--------------------------|------|----------------------|
|                                                 | 成交金额          | 占当期<br>债券<br>成交总<br>额的比例 | 成交金额   | 占当期债<br>券回购<br>成交总额<br>的比例 | 成交金额 | 占当期<br>权证<br>成交总<br>额的比例 | 成交金额 | 占当期基<br>金成交<br>总额的比例 |
| Zhongtai International                          | 21,921,650.85 | 27.08%                   | -      | -                          | -    | -                        | -    | -                    |
| Mizuho Securities                               | 16,218,251.20 | 20.03%                   | -      | -                          | -    | -                        | -    | -                    |
| Australia and New Zealand Banking Group Limited | 10,949,739.67 | 13.53%                   | -      | -                          | -    | -                        | -    | -                    |
| Citigroup                                       | 9,947,651.01  | 12.29%                   | -      | -                          | -    | -                        | -    | -                    |
| Bank of Ningbo                                  | 5,561,578.00  | 6.87%                    | -      | -                          | -    | -                        | -    | -                    |
| Guotai Junan Securities HK                      | 5,004,011.90  | 6.18%                    | -      | -                          | -    | -                        | -    | -                    |
| CSI Global Markets Limited                      | 4,183,660.28  | 5.17%                    | -      | -                          | -    | -                        | -    | -                    |
| Bank of China International                     | 2,223,922.23  | 2.75%                    | -      | -                          | -    | -                        | -    | -                    |
| Goldman Sachs                                   | 2,003,666.40  | 2.47%                    | -      | -                          | -    | -                        | -    | -                    |
| China International Capital Corporation         | 1,546,572.34  | 1.91%                    | -      | -                          | -    | -                        | -    | -                    |
| Deutsche Bank Sec                               | 1,396,675.29  | 1.73%                    | -      | -                          | -    | -                        | -    | -                    |
| Morgan Stanley                                  | -             | -                        | -      | -                          | -    | -                        | -    | -                    |
| Haitong International Securities                | -             | -                        | -      | -                          | -    | -                        | -    | -                    |
| 长江证券                                            | -             | -                        | -      | -                          | -    | -                        | -    | -                    |

## 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旗下部分基金春节假期延长期间交易规则的提示性公告      | 中国证监会规定的媒介 | 2020 年 1 月 29 日 |
| 2  | 关于调整旗下部分基金在直销电子交易系统最低定期定额投资金额及最低转换份额的公告     | 中国证监会规定的媒介 | 2020 年 2 月 14 日 |
| 3  | 关于工银瑞信全球美元债债券型证券投资基金(QDII)变更基金经理的公告         | 中国证监会规定的媒介 | 2020 年 2 月 19 日 |
| 4  | 工银瑞信基金管理有限公司关于副总经理变更的公告                     | 中国证监会规定的媒介 | 2020 年 2 月 22 日 |
| 5  | 关于暂停泰诚财富基金销售(大连)有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告         | 中国证监会规定的媒介 | 2020 年 3 月 25 日 |
| 6  | 工银瑞信基金管理有限公司关于延迟披露旗下公募基金 2019 年年度报告的公告      | 中国证监会规定的媒介 | 2020 年 3 月 26 日 |
| 7  | 工银瑞信基金管理有限公司关于终止中天嘉华基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告 | 中国证监会规定的媒介 | 2020 年 5 月 26 日 |
| 8  | 工银瑞信基金管理有限公司关于终止深圳富济基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告 | 中国证监会规定的媒介 | 2020 年 6 月 11 日 |

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 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

无。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

自 2020 年 2 月 17 日起,陈涵担任工银瑞信全球美元债债券型证券投资基金(QDII)的基金经理,刘琦不再担任工银瑞信全球美元债债券型证券投资基金(QDII)的基金经理,详见基金管理人在规定媒介上发布的公告。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

1、中国证监会准予工银瑞信全球美元债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。

## 12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的住所。

## 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](http://www.icbccs.com.cn)

工银瑞信基金管理有限公司

2020 年 8 月 28 日