

工银瑞信尊益中短债债券型证券投资基金
(原工银瑞信 60 天理财债券型证券投资基金)

2020 年第 3 季度报告

2020 年 9 月 30 日

基金管理人：工银瑞信基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

报告送出日期：2020 年 10 月 27 日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 10 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

原工银瑞信 60 天理财债券型证券投资基金报告期自 2020 年 7 月 1 日起至 2020 年 7 月 19 日止，工银瑞信尊益中短债债券型证券投资基金自 2020 年 7 月 20 日（基金合同生效日）起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

2.1 基金基本情况（转型后）

基金简称	工银尊益中短债债券
基金主代码	485122
基金运作方式	契约型、开放式
基金合同生效日	2020 年 7 月 20 日
报告期末基金份额总额	261,120,791.55 份
投资目标	本基金在严格控制风险的基础上，重点投资于中短期债券，力求获得超出业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金将考察市场利率的动态变化及预期变化，对 GDP、CPI、PPI、外汇收支及国际市场流动性动态情况等引起利率变化的相关因素进行深入的研究，分析国际与国内宏观经济运行的可能情景，并在此基础上判断包括财政政策以及国内和主要发达国家及地区的货币政策、汇率政策在内的宏观经济政策取向，对市场利率水平和收益

	率曲线未来的变化趋势做出预测和判断，结合债券市场资金及债券的供求结构及变化趋势，确定固定收益类资产的久期配置。		
业绩比较基准	中债综合财富指数（1-3 年）指数收益率。		
风险收益特征	本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金及混合型基金，高于货币市场基金。		
基金管理人	工银瑞信基金管理有限公司		
基金托管人	兴业银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	工银尊益中短债债券 A	工银尊益中短债债券 C	工银尊益中短债债券 F
下属分级基金的交易代码	009655	485122	485022
报告期末下属分级基金的份额总额	209,672.30 份	260,911,119.25 份	-

2.1 基金基本情况（转型前）

基金简称	工银 60 天理财债券	
基金主代码	485122	
基金运作方式	契约型、开放式	
基金合同生效日	2013 年 1 月 28 日	
报告期末基金份额总额	305,358,840.64 份	
投资目标	在控制风险并保持资产流动性的基础上，力争实现超过业绩比较基准的投资收益。	
投资策略	本基金将采取利率策略、信用策略、相对价值策略等积极投资策略，在严格控制风险的前提下，发掘和利用市场失衡提供的投资机会，实现组合增值。	
业绩比较基准	人民币七天通知存款税后利率。	
风险收益特征	本基金为债券型基金，预期收益和风险水平低于混合型基金、股票型基金，高于货币市场基金。	
基金管理人	工银瑞信基金管理有限公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	工银 60 天理财债券 A	工银 60 天理财债券 B

下属分级基金的交易代码	485122	485022
报告期末下属分级基金的份额总额	305,358,840.64 份	-

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标（转型后）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2020 年 7 月 20 日-2020 年 9 月 30 日）		
	工银尊益中短债债券 A	工银尊益中短债债券 C	工银尊益中短债债券 F
1. 本期已实现收益	1,414.53	2,513,570.49	-
2. 本期利润	218.41	1,749,754.45	-
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0011	0.0063	-
4. 期末基金资产净值	209,882.30	262,436,315.24	-
5. 期末基金份额净值	1.0010	1.0058	-

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益是指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、所列数据截止到报告期最后一日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

4、转型起始日为 2020 年 7 月 20 日。

5、本基金本报告期无 F 类份额。

3.1 主要财务指标（转型前）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2020 年 7 月 1 日-2020 年 7 月 19 日）	
	工银 60 天理财债券 A	工银 60 天理财债券 B
1. 本期已实现收益	348,698.63	909.90
2. 本期利润	348,698.63	909.90
3. 期末基金资产净值	305,358,840.64	-

注：1、本基金收益分配是按日结转份额。

2、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，由于货币市场基金采用摊余成本法核算，因此公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

4、所列数据截止到报告期最后一日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

3.2 基金净值表现（转型后）

3.2.1 本报告期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

工银尊益中短债债券 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
过去三个月	0.10%	0.06%	0.16%	0.03%	-0.06%	0.03%
自基金合同生效起至今	0.10%	0.06%	0.16%	0.03%	-0.06%	0.03%

工银尊益中短债债券 C

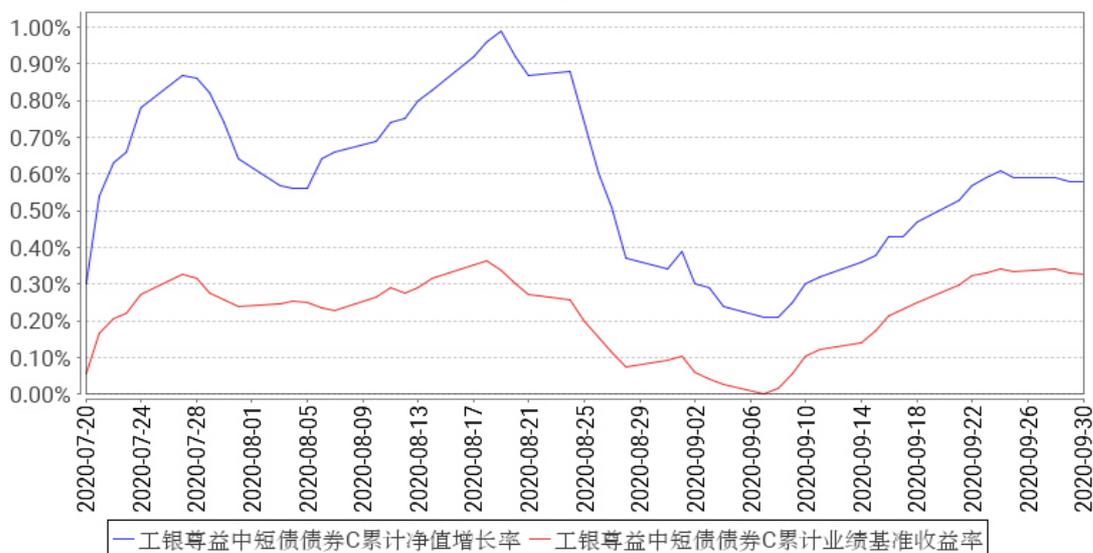
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.58%	0.08%	0.33%	0.03%	0.25%	0.05%
自基金合同生效起至今	0.58%	0.08%	0.33%	0.03%	0.25%	0.05%

3.2.2 自基金转型以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

工银尊益中短债债券A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



工银尊益中短债债券C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 2020 年 7 月 20 日生效。截至报告期末，本基金尚处于建仓期。

2、根据基金合同规定，本基金建仓期为 6 个月。建仓期满，本基金的投资应符合基金合同关于投资范围及投资限制的规定：债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%，其中投资于中短期债券的比例不低于非现金基金资产的 80%，每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值的 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

3.2 基金净值表现（转型前）

3.2.1 本报告期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 60 天理财债券 A

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.1056%	0.0051%	0.0701%	0.0000%	0.0355%	0.0051%
过去六个月	1.0375%	0.0176%	0.4057%	0.0000%	0.6318%	0.0176%
过去一年	2.7183%	0.0131%	1.0817%	0.0000%	1.6366%	0.0131%
过去三年	10.1779%	0.0090%	3.7817%	0.0000%	6.3962%	0.0090%
过去五年	17.5072%	0.0075%	6.4817%	0.0000%	11.0255%	0.0075%
自基金合同生效起至今	33.5270%	0.0078%	10.0915%	0.0000%	23.4355%	0.0078%

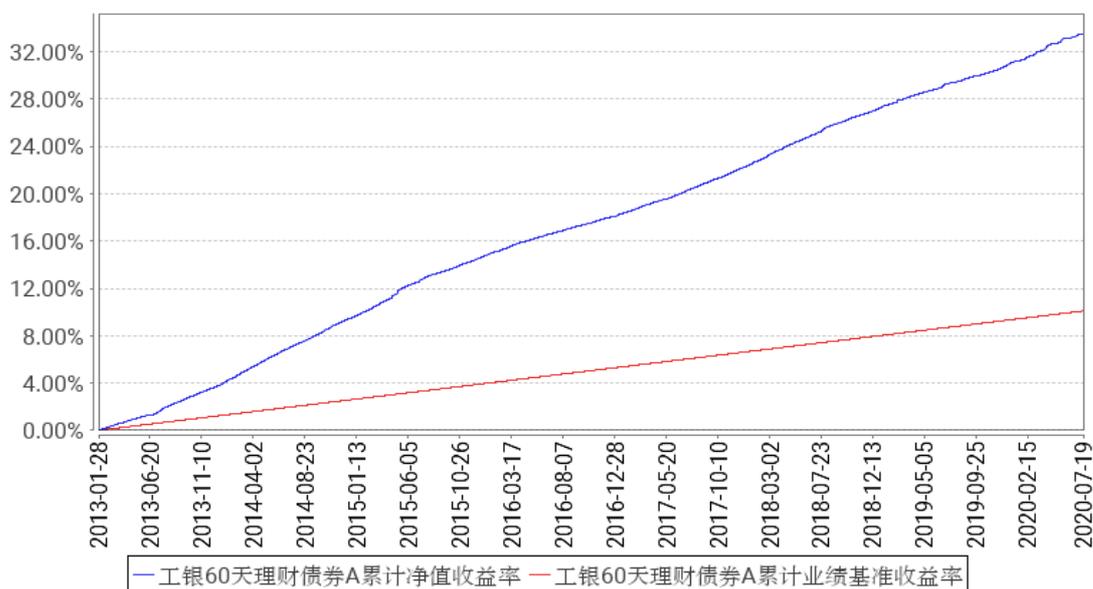
工银 60 天理财债券 B

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.1056%	0.0051%	0.0701%	0.0000%	0.0355%	0.0051%
过去六个月	1.0375%	0.0176%	0.4057%	0.0000%	0.6318%	0.0176%
过去一年	2.7183%	0.0131%	1.0817%	0.0000%	1.6366%	0.0131%
过去三年	10.1779%	0.0090%	3.7817%	0.0000%	6.3962%	0.0090%
过去五年	17.5072%	0.0075%	6.4817%	0.0000%	11.0255%	0.0075%
自基金合同生效起至今	33.5270%	0.0078%	10.0915%	0.0000%	23.4355%	0.0078%

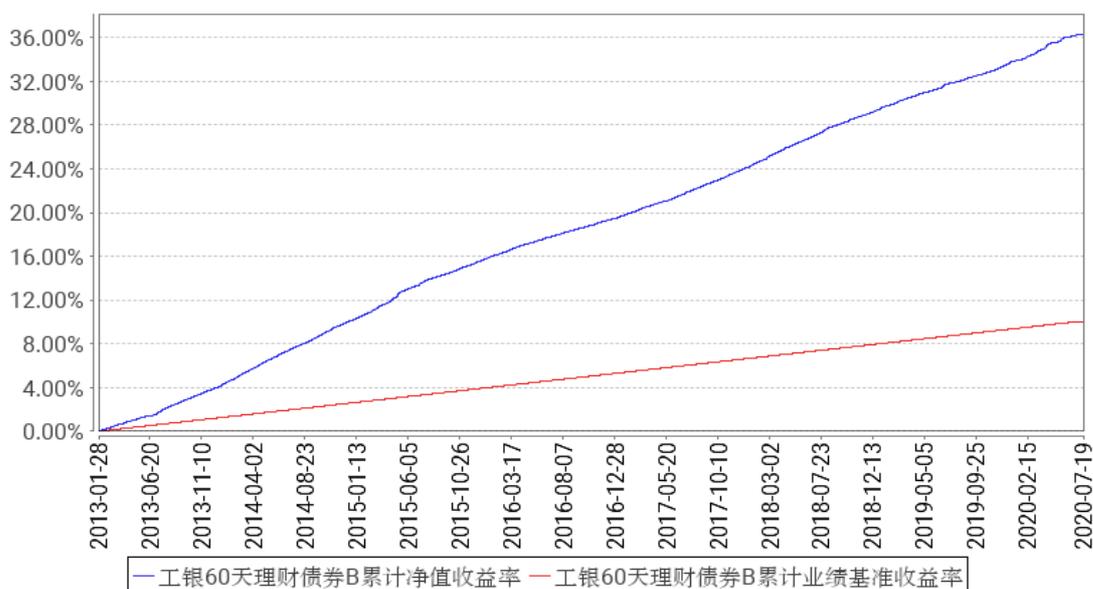
				④		
过去三个月	0.0171%	0.0000%	0.0037%	0.0000%	0.0134%	0.0000%
过去六个月	1.0182%	0.0190%	0.3393%	0.0000%	0.6789%	0.0190%
过去一年	2.8481%	0.0134%	1.0153%	0.0000%	1.8328%	0.0134%
过去三年	10.9591%	0.0090%	3.7153%	0.0000%	7.2438%	0.0090%
过去五年	19.0296%	0.0075%	6.4153%	0.0000%	12.6143%	0.0075%
自基金合同生效起至今	36.3134%	0.0078%	10.0251%	0.0000%	26.2883%	0.0078%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

工银60天理财债券A累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



工银60天理财债券B累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2013 年 1 月 28 日生效。

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

3.3 其他指标

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型后）

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
谷衡	固定收益部副总监，本基金的基金经理	2020 年 7 月 20 日	-	15 年	先后在华夏银行总行担任交易员，在中信银行总行担任交易员；2012 年加入工银瑞信，现任固定收益部副总监；2012 年 11 月 13 日至今，担任工银瑞信 14 天理财债券型发起式证券投资基金；2013 年 1 月 28 日至今，担任工银瑞信尊益中短债债券型证券投资基金基金经理（2020 年 7 月 20 日转型，转型前为工银瑞信 60 天理财债券型基金）；2014 年 9 月 30 日至今，担任工银瑞信货币市场基金基金经理；2015 年 7 月 10 日至 2018 年 2 月 28 日，担任工银瑞信财富快线货币市场基金基金经理；2015 年 12 月 14 日至 2018 年 8 月 28 日，担任工银瑞信添福债券基金基金经理；2016 年 4 月 26 日至 2018 年 4 月 9 日，担任工银瑞信安盈货币市场基金基金经理；2016 年 12 月 7 日至 2018 年 3 月 28 日，担任工银瑞信丰益一年定期开放债券型证券投资基金基金经理；2017 年 2 月 28 日至 2019 年 1 月 24 日，担任工银瑞信丰淳半年定期开放债券型证券投资基金（自 2017 年 9 月 23 日起，变更为工银瑞信丰淳半年定期开放债券型发起式证券投资基金）基金经理；2017 年 6 月 12 日至 2018 年 11 月 30 日，担任工银

					瑞信丰实三年定期开放债券型证券投资基金基金经理；2017 年 12 月 26 日至今，担任工银瑞信纯债债券型证券投资基金基金经理；2018 年 2 月 28 日至今，担任工银瑞信信用添利债券型证券投资基金基金经理；2018 年 6 月 15 日至 2019 年 8 月 14 日，担任工银瑞信瑞祥定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理；2018 年 11 月 7 日至 2020 年 1 月 9 日，担任工银瑞信恒享纯债债券型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	---

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期末本基金的基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型前）

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
谷衡	固定收益部副总监，本基金的基金经理	2013 年 1 月 28 日	-	15 年	先后在华夏银行总行担任交易员，在中信银行总行担任交易员；2012 年加入工银瑞信，现任固定收益部副总监；2012 年 11 月 13 日至今，担任工银瑞信 14 天理财债券型发起式证券投资基金；2013 年 1 月 28 日至今，担任工银瑞信尊益中短债债券型证券投资基金基金经理（2020 年 7 月 20 日转型，转型前为工银瑞信 60 天理财债券型基金）；2014 年 9 月 30 日至今，担任工银瑞信货币市场基金基金经理；2015 年 7 月 10 日至 2018 年 2 月 28 日，担任工银瑞信财富快线货币市场基金基金经理；2015 年 12 月 14 日至 2018 年 8 月 28 日，担任工银瑞信添福债券基金基金经理；2016 年 4 月 26 日至 2018 年 4 月 9 日，担任工银瑞信安盈货币市场基金基金经理；2016 年 12 月 7 日至 2018 年 3 月 28 日，担任工银瑞信丰益一年定期开放债券型证券投资基金基金经理；2017 年 2 月 28 日至 2019 年 1 月 24 日，担任工银瑞信丰淳半年定期开放债券型证券

					投资基金（自 2017 年 9 月 23 日起，变更为工银瑞信丰淳半年定期开放债券型发起式证券投资基金）基金经理；2017 年 6 月 12 日至 2018 年 11 月 30 日，担任工银瑞信丰实三年定期开放债券型证券投资基金基金经理；2017 年 12 月 26 日至今，担任工银瑞信纯债债券型证券投资基金基金经理；2018 年 2 月 28 日至今，担任工银瑞信信用添利债券型证券投资基金基金经理；2018 年 6 月 15 日至 2019 年 8 月 14 日，担任工银瑞信瑞祥定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理；2018 年 11 月 7 日至 2020 年 1 月 9 日，担任工银瑞信恒享纯债债券型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	--

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

为了公平对待各类投资人，保护各类投资人利益，避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为，公司根据《证券投资基金法》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规和公司内部规章，制定了《公平交易管理办法》、《异常交易监控管理办法》，对公司管理的各类资产的公平对待做了明确具体的规定，并规定对买卖股票、债券时候的价格和市场价格差距较大，可能存在操纵股价、利益输送等违法违规情况进行监控。本报告期，按照时间优先、价格优先的原则，本公司对满足限价条件且对同一证券有相同交易需求的基金等投资组合，均采用了系统中的公平交易模块进行操作，实现了公平交易；未出现清算不到位的情况，且本基金及本基金与本基金管理人管理的其他投资组合之间未发生法律法规禁止的反向交易及交叉交易。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内未出现异常交易的情况。本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的 5%。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

基本面在三季度延续了二季度的复苏表现，出口和消费等前期受疫情影响较大的行业接力地产和基建等投资需求，成为基本面回升的新增动能，带动经济向潜在增速回归。另一方面几个核心价格指数回升仍然较为缓慢，工业品 PPI 虽然环比有所反弹，但同比增速仍处于负值区间，核心 CPI 则处于历史最低值，反映出居民端消费复苏的基础并不牢固。货币政策总体强调灵活适度的方向，在社会融资增速与名义 GDP 增速出现较大偏离的情形下，总量政策的应用较为谨慎，主要通过公开市场操作、中期借贷便利的方式来补充市场流动性，货币市场流动性回归中性。

整体流动性的边际收缩使得三季度货币市场利率出现显著上行，银行主动负债吸收意愿加强，以 Shibor3M 为代表的银行负债成本三季末位于 2.69%，较二季末上行 56BP。同时，国债和地方政府债的大量发行造成债券市场供需关系的阶段性失衡，叠加 7 月初以来 A 股指数的震荡上行带来风险偏好提升，债券资产持续被抛售。具体来看，1 年期国债到期收益率由二季度末的 2.18% 上行至三季度末的 2.65%，10 年期国债到期收益率由二季度末的 2.82% 上行至三季度末的 3.15%，3 年期 AA+ 信用债券与同期限国债的利差从二季度末的 102BP 收缩至三季度末的 96BP。

本基金在报告期内基于市场判断和整体资产比价效应的变化，在转型为中短债基金后，主要配置了 3 年以内的中高等级信用债，同时严控信用债配置的信用资质，保持组合较好的流动性以应对投资者需求。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内，工银 60 天理财债券（转型前）A 份额净值增长率为 0.1056%，工银 60 天理财债券（转型前）B 份额净值增长率为 0.0171%，A 份额业绩比较基准收益率为 0.0701%，B 份额业绩比较基准收益率为 0.0037%；工银瑞信尊益中短债（转型后）A 份额净值增长率为 0.10%，工银瑞信尊益中短债（转型后）C 份额净值增长率为 0.58%，A 份额业绩比较基准收益率为 0.16%，C 份额业绩比较基准收益率为 0.33%；工银瑞信尊益中短债（转型后）F 份额份额数为 0。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金在报告期内没有触及 2014 年 8 月 8 日生效的《公开募集证券投资基金运作管理办法》

第四十一条规定的条件。

§ 5 投资组合报告（转型后）

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	349,837,400.00	98.09
	其中：债券	311,761,400.00	87.41
	资产支持证券	38,076,000.00	10.68
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	2,555,494.31	0.72
8	其他资产	4,273,164.87	1.20
9	合计	356,666,059.18	100.00

注：由于四舍五入的原因金额占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有境内股票投资。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.3 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投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	39,161,000.00	14.91
	其中：政策性金融债	39,161,000.00	14.91
4	企业债券	163,984,400.00	62.44
5	企业短期融资券	-	-

6	中期票据	108,616,000.00	41.35
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	311,761,400.00	118.70

注：由于四舍五入的原因公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

5.5 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（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	101900761	19 首钢 MTN004	200,000	20,340,000.00	7.74
2	163789	20 浦土 02	200,000	19,912,000.00	7.58
3	163774	20 中证 15	200,000	19,898,000.00	7.58
4	149173	20 申证 06	200,000	19,848,000.00	7.56
5	132000008	20 江苏铁路 GN001	200,000	19,710,000.00	7.50

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资 明细

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	165091	19 国风 1A	190,000	18,998,100.00	7.23
2	138426	瑞新 13A1	100,000	10,043,000.00	3.82
3	138452	瑞新 14A1	50,000	5,016,500.00	1.91
4	138389	瑞新 12A1	40,000	4,018,400.00	1.53

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

本报告期内，本基金未运用国债期货进行投资。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货投资，也无期间损益。

5.9.3 本期国债期货投资评价

本报告期内，本基金未运用国债期货进行投资。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.10.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	18,792.19
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,209,241.01
5	应收申购款	45,131.67
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,273,164.87

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 5 投资组合报告（转型前）

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	固定收益投资	406,378,099.90	98.57
	其中：债券	351,041,709.17	85.15
	资产支持证券	55,336,390.73	13.42
	券		

2	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的 买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备 付金合计	888,075.88	0.22
4	其他资产	4,987,809.16	1.21
5	合计	412,253,984.94	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值比例 (%)	
1	报告期内债券回购融资余额	34.29	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额 (元)	占基金资产净值 比例 (%)
2	报告期末债券回购融资余额	106,599,746.70	34.91
	其中：买断式回购融资	-	-

注：报告期内债券融资回购余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 40% 的说明

本报告期内本基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的 40%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	120
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	141
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	122

报告期内投资组合平均剩余期限超过 180 天情况说明

本报告期内本基金投资组合平均剩余期限未超过 180 天。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净 值的比例 (%)	各期限负债占基金资产净 值的比例 (%)
1	30 天以内	15.42	34.91
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动 利率债	-	-
2	30 天 (含) —60 天	23.29	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动	-	-

	利率债		
3	60 天（含）—90 天	6.55	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	12.78	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	75.34	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	133.37	34.91

5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

本报告期内本基金投资组合平均剩余存续期未超过 240 天。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	20,115,126.31	6.59
	其中：政策性金融债	20,115,126.31	6.59
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	270,039,540.09	88.43
6	中期票据	60,887,042.77	19.94
7	同业存单	-	-
8	其他	-	-
9	合计	351,041,709.17	114.96
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

注：上表中，债券的成本包括债券面值和折溢价。

5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量（张）	摊余成本（元）	占基金资产净值比例（%）
1	101800171	18 华润置地 MTN001	300,000	30,554,837.13	10.01
2	101578005	15 京首钢	300,000	30,332,205.64	9.93

		MTN001			
3	012000783	20 成交投 SCP003	300,000	30,000,339.97	9.82
4	041900471	19 冀交投 CP002	300,000	30,000,289.77	9.82
5	012000331	20 皖投集 SCP001	300,000	30,000,199.37	9.82
6	011902828	19 豫交投 SCP003	300,000	29,985,284.86	9.82
7	042000066	20 河钢集 CP002	200,000	20,025,028.09	6.56
8	042000040	20 陕煤化 CP001	200,000	20,023,487.68	6.56
9	042000063	20 冀建投(疫情 防控债)CP001	200,000	20,013,446.39	6.55
10	011902759	19 首钢 SCP012	200,000	20,001,942.76	6.55

注：上表中，债券的成本包括债券面值和折溢价。

5.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25（含）-0.5%间的次数	7
报告期内偏离度的最高值	0.3561%
报告期内偏离度的最低值	0.2339%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.2836%

注：上表中“偏离情况”根据报告期内各交易日数据计算。

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本报告期内，本基金负偏离度的绝对值未达到 0.25%。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

本报告期内，本基金正偏离度的绝对值未达到 0.5%。

5.8 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资 明细

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	摊余成本（元）	占基金资产净值 比例（%）
1	165091	19 国风 1A	190,000	19,000,000.00	6.22
2	159942	悦秀 1 优	100,000	10,000,000.00	3.27
3	138426	瑞新 13A1	100,000	10,000,000.00	3.27
4	159447	19 中铝 1A	110,000	6,198,490.73	2.03
5	138452	瑞新 14A1	50,000	5,000,000.00	1.64
6	138389	瑞新 12A1	40,000	4,000,000.00	1.31
7	138431	惠安 1A1	30,000	1,137,900.00	0.37

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 基金计价方法说明

本基金采用固定份额净值，基金账面份额净值始终保持为人民币 1.0000 元。本基金估值采用摊余成本法，即估值对象以买入成本列示，按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内按实际利率法进行摊销，每日计提收益或损失。

5.9.2 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	988.32
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	4,986,820.84
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	4,987,809.16

5.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§6 开放式基金份额变动（转型后）

单位：份

项目	工银尊益中短债债券 A	工银尊益中短债债券 C	工银尊益中短债债券 F
报告期期初基金份额总额	-	305,358,840.64	-
报告期期间基金总申购份额	234,507.64	9,067,904.40	-
减：报告期期间基金总赎回份额	24,835.34	53,515,625.79	-
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-	-
报告期期末基金份额总额	209,672.30	260,911,119.25	-

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。

§6 开放式基金份额变动（转型前）

单位：份

项目	工银 60 天理财债券 A	工银 60 天理财债券 B
报告期期初基金份额总额	348,379,832.78	5,319,914.75
报告期期间基金总申购份额	564,620.30	4,471.41
报告期期间基金总赎回份额	43,585,612.44	5,324,386.16
报告期期末基金份额总额	305,358,840.64	-

注：1、报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额；

2、报告期期间基金总赎回份额含转换出份额。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型后）

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细（转型前）

无。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

工银瑞信 60 天理财债券型证券投资基金以通讯开会方式召开了基金份额持有人大会，于 2020 年 6 月 16 日表决通过了《关于工银瑞信 60 天理财债券型证券投资基金变更相关事项的议案》。自 2020 年 7 月 20 日起，工银瑞信 60 天理财债券型证券投资基金更名为工银瑞信尊益中短债债券

型证券投资基金，《工银瑞信尊益中短债债券型证券投资基金基金合同》、《工银瑞信尊益中短债债券型证券投资基金托管协议》生效，《工银瑞信 60 天理财债券型证券投资基金基金合同》、《工银瑞信 60 天理财债券型证券投资基金托管协议》同日失效。详见基金管理人在规定媒介上发布的公告。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予工银瑞信 60 天理财债券型证券投资基金变更注册的文件；
- 2、《工银瑞信尊益中短债债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《工银瑞信尊益中短债债券型证券投资基金托管协议》；
- 4、《工银瑞信尊益中短债债券型证券投资基金招募说明书》；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、报告期内基金管理人在规定媒介上披露的各项公告。

9.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的住所。

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅。也可在支付工本费后，在合理时间内取得上述文件的复印件。

工银瑞信基金管理有限公司

2020 年 10 月 27 日