

工银瑞信信用纯债三个月定期开放债券型
证券投资基金(原工银瑞信信用纯债两年
定期开放债券型证券投资基金)
2021 年第 3 季度报告

2021 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：交通银行股份有限公司

报告送出日期：2021 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 10 月 25 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。

原工银瑞信信用纯债两年定期开放债券型证券投资基金报告期自 2021 年 7 月 1 日起至 2021 年 8 月 2 日止，工银瑞信信用纯债三个月定期开放债券型证券投资基金报告期自 2021 年 8 月 3 日（基金合同生效日）起至 2021 年 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	工银信用纯债三个月定开债券
基金主代码	000078
基金运作方式	契约型、定期开放式
基金合同生效日	2021 年 8 月 3 日
报告期末基金份额总额	623,194,414.12 份
投资目标	在严格控制风险，保持较高流动性的前提下，追求基金资产的长期稳健增值，力争为基金持有人获取超越业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金的主要投资策略包括：期限配置策略、期限结构策略、信用债券投资策略、证券选择策略、短期和中长期的市场环境中的投资策略及资产支持证券等品种投资策略，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，实现组合资产的增值。

业绩比较基准	80%×中债信用债（财富）总指数收益率+20%×中债国开行债券（1~3 年）总财富指数收益率。	
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	交通银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	工银信用纯债三个月定开债券 A	工银信用纯债三个月定开债券 C
下属分级基金的交易代码	000078	000079
报告期末下属分级基金的份额总额	618,844,315.46 份	4,350,098.66 份

2.1 基金基本情况（转型前）

基金简称	工银信用纯债两年定开债券
基金主代码	000078
基金运作方式	契约型、定期开放式
基金合同生效日	2013 年 6 月 24 日
报告期末基金份额总额	623,202,874.36 份
投资目标	在严格控制风险，保持较高流动性的前提下，追求基金资产的长期稳健增值，力争为基金持有人获取超越业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金的主要投资策略包括：期限配置策略、期限结构策略、信用债券投资策略、证券选择策略、短期和中长期的市场环境中的投资策略及资产支持证券等品种投资策略，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，实现组合资产的增值。
业绩比较基准	二年期银行定期存款税后收益率+1.2%。
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。
基金管理人	工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司

下属分级基金的基金简称	工银信用纯债两年定开债券 A	工银信用纯债两年定开债券 C
下属分级基金的交易代码	000078	000079
报告期末下属分级基金的份额总额	618,844,315.46 份	4,358,558.90 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（2021 年 8 月 3 日-2021 年 9 月 30 日）	
	工银信用纯债三个月定开债券 A	工银信用纯债三个月定开债券 C
1. 本期已实现收益	6,886,227.14	43,017.59
2. 本期利润	-2,202,305.10	-18,892.88
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0036	-0.0043
4. 期末基金资产净值	881,963,632.26	6,006,326.62
5. 期末基金份额净值	1.4252	1.3807

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 2021 年 8 月 3 日。

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（2021 年 7 月 1 日-2021 年 8 月 2 日）	
	工银信用纯债两年定开债券 A	工银信用纯债两年定开债券 C
1. 本期已实现收益	3,532,192.49	23,557.69
2. 本期利润	10,610,770.50	77,953.35
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0171	0.0161
4. 期末基金资产净值	884,165,937.36	6,036,936.93
5. 期末基金份额净值	1.429	1.385

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

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

3、所列数据截止到报告期最后一日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

3.2 基金净值表现（转型后）

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

工银信用纯债三个月定开债券 A

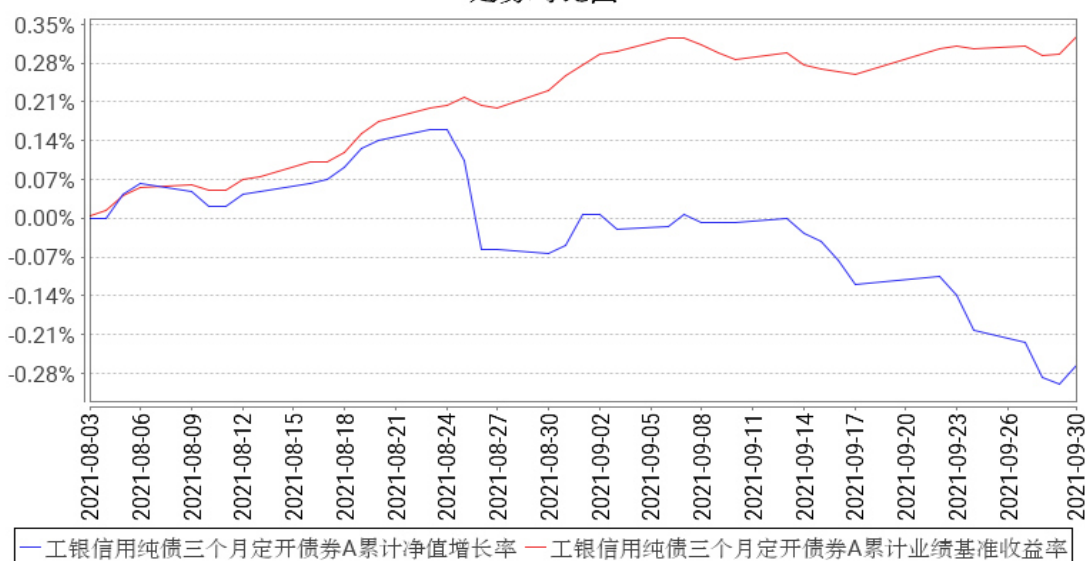
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
自基金合同生效起至今	-0.27%	0.04%	0.33%	0.02%	-0.60%	0.02%

工银信用纯债三个月定开债券 C

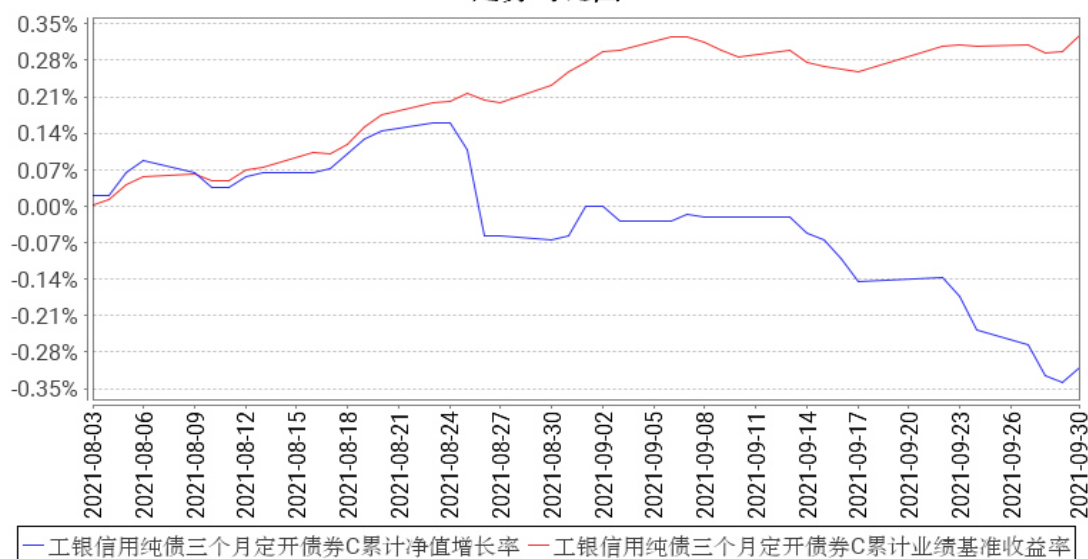
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
自基金合同生效起至今	-0.31%	0.04%	0.33%	0.02%	-0.64%	0.02%

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

工银信用纯债三个月定开债券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



工银信用纯债三个月定开债券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、本基金于 2021 年 8 月 3 日由工银瑞信信用纯债两年定期开放债券型证券投资基金转型而来。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：本基金投资于债券的比例不低于基金资产的 80%，其中信用债券的投资比例不低于非现金资产的 80%，但在每个开放期开始前 10 个工作日、开放期及开放期结束后 10 个工作日内，基金投资不受前述投资组合比例限制。本基金在封闭期内持有现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不受限制，但在开放期内现金及到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

3.2 基金净值表现（转型前）

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

工银信用纯债两年定开债券 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	1.20%	0.05%	0.30%	0.01%	0.90%	0.04%
过去六个月	2.51%	0.05%	1.12%	0.01%	1.39%	0.04%
过去一年	3.70%	0.07%	2.76%	0.01%	0.94%	0.06%

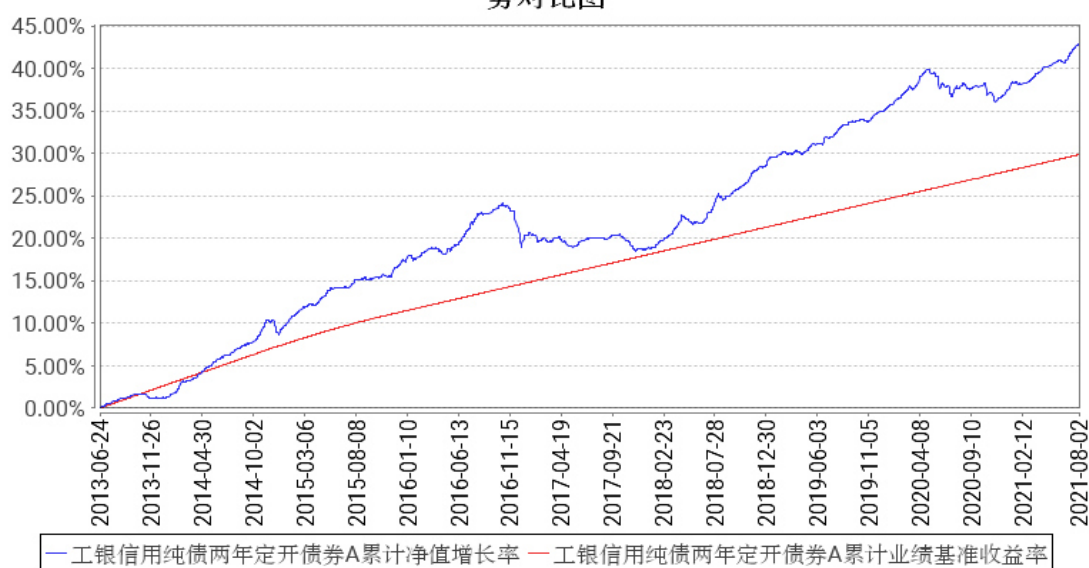
过去三年	13.68%	0.07%	9.37%	0.01%	4.31%	0.06%
过去五年	15.80%	0.08%	15.96%	0.01%	-0.16%	0.07%
自基金合同生效起至今	42.90%	0.08%	29.85%	0.01%	13.05%	0.07%

工银信用纯债两年定开债券 C

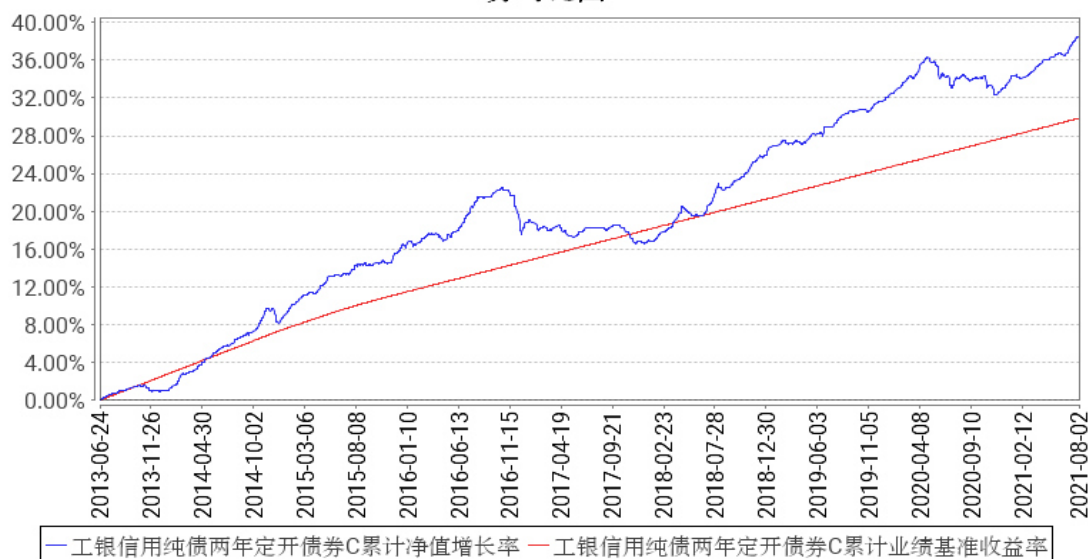
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.17%	0.06%	0.30%	0.01%	0.87%	0.05%
过去六个月	2.29%	0.05%	1.12%	0.01%	1.17%	0.04%
过去一年	3.28%	0.07%	2.76%	0.01%	0.52%	0.06%
过去三年	12.42%	0.07%	9.37%	0.01%	3.05%	0.06%
过去五年	13.52%	0.08%	15.96%	0.01%	-2.44%	0.07%
自基金合同生效起至今	38.50%	0.08%	29.85%	0.01%	8.65%	0.07%

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

工银信用纯债两年定开债券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



工银信用纯债两年定开债券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 2013 年 6 月 24 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：债券等固定收益类资产占基金资产净值的比例不低于 80%，其中信用债券的投资比例不低于本基金固定收益类资产投资的 80%，但在每个受限开放期的前 10 个工作日、受限开放期期间及受限开放期的后 10 个工作日、自由开放期前三个月、自由开放期期间及自由开放期结束后三个月的期间内，基金投资不受前述投资组合比例限制；本基金在封闭期内持有现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不受限制，但在开放期内现金及到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

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		
朱晨杰	本基金的基金经理	2021 年 8 月 3 日	—	9 年	先后在海通证券股份有限公司担任债券销售交易，在平安证券股份有限公司担任投资经理，在中欧基金管理有限公司担任基金经理；2018 年加入工银瑞信基金管理有限公司，现任养老金投资中心基金经理；2019 年 10 月 8 日至今，担任工银瑞

					信信用纯债两年定期开放债券型证券投资基金（自 2021 年 8 月 3 日起，变更为工银瑞信信用纯债三个月定期开放债券型证券投资基金）基金经理；2021 年 8 月 13 日至今，担任工银瑞信聚安混合型证券投资基金基金经理；2021 年 9 月 24 日至今，担任工银瑞信聚益混合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（转型后）

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		
朱晨杰	本基金的基金经理	2019 年 10 月 8 日	2021 年 8 月 2 日	9 年	先后在海通证券股份有限公司担任债券销售交易，在平安证券股份有限公司担任投资经理，在中欧基金管理有限公司担任基金经理；2018 年加入工银瑞信基金管理有限公司，现任养老金投资中心基金经理；2019 年 10 月 8 日至今，担任工银瑞信信用纯债两年定期开放债券型证券投资基金（自 2021 年 8 月 3 日起，变更为工银瑞信信用纯债三个月定期开放债券型证券投资基金）基金经理；2021 年 8 月 13 日至今，担任工银瑞信聚安混合型证券投资基金基金经理；2021 年 9 月 24 日至今，担任工银瑞信聚益混合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（转型前）

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 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。

4.3 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。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度债券市场表现强势，10 年期国债期货 7 月单月上涨 1.96%，随后两个月以高位震荡为主。10 年期国开债收益率下行 22BP 左右，AAA 3 年期中票收益率下行 20BP 左右，AAA 5 年期中票收益率下行 20BP 左右，收益率下行幅度明显。在 7 月央行超预期的降准政策以后，债券市场氛围重回乐观，在宽松的资金面及逐渐走弱的经济数据配合下，各期限债券表现强势，久期及杠杆策略明显占优。

三季度国内外疫情的反复及变种病毒的高传播性继续阶段性的对国内外经济产生影响，居民的收入及消费也因此面临了一定的压力。政策方面，在上半年经济增长动能较强的阶段，国内主

动收缩了地产以及基建方面投资的动力，收缩的影响在下半年逐渐显现。尤其是房地产金融方面的管控导致整个地产链条有明显的下滑趋势。在此背景下我们看到了经济数据及金融数据的逐步走弱，未来经济基本面压力较大。

此外在双碳双控的影响下，上游资源品价格保持强势，南华工业品指数 3 季度上涨了 15% 左右，PPI 读数高企。在此背景下上游的价格压力逐渐向中下游传导，未来潜在的通胀压力值得我们警惕。双控的严格执行也对工业生产产生了一定负面影响，地方考核压力较大的省份采取了限电断电的举措，未来对产出和经济增长造成拖累。

总体我们现在面临的是经济有下行压力，上游价格正逐步向下游传导的宏观环境。后续需要关注偏弱的经济数据下政策边际转向宽信用的变化。

本基金本报告期内债券配置以高等级信用债为主，减持了部分绝对收益率偏低的信用债，控制信用风险的暴露，降低了组合杠杆水平，久期保持中性。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内，工银信用纯债两年定开债券（转型前）A 份额净值增长率为 1.2%，C 份额净值增长率为 1.17%，业绩比较基准收益率为 0.3%；工银信用纯债三个月定开债券（转型后）A 份额净值增长率为-0.27%，本基金 C 份额净值增长率为-0.31%，业绩比较基准收益率为 0.33%。

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	1,124,362,500.00	96.13
	其中：债券	1,067,884,800.00	91.31
	资产支持证券	56,477,700.00	4.83
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	2,635,975.20	0.23
8	其他资产	42,568,026.74	3.64
9	合计	1,169,566,501.94	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 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	554,981,000.00	62.50
	其中：政策性金融债	180,300,000.00	20.30
4	企业债券	126,951,800.00	14.30
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	268,898,000.00	30.28
7	可转债（可交换债）	—	—
8	同业存单	117,054,000.00	13.18
9	其他	—	—
10	合计	1,067,884,800.00	120.26

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	160218	16 国开 18	600,000	60,162,000.00	6.78
2	180412	18 农发 12	600,000	60,102,000.00	6.77
3	200314	20 进出 14	600,000	60,036,000.00	6.76
4	112110029	21 兴业银行 CD029	600,000	58,818,000.00	6.62
5	112003119	20 农业银行	600,000	58,236,000.00	6.56

		CD119			
--	--	-------	--	--	--

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	137657	中铁 8 优 A	100,000	10,065,000.00	1.13
2	189304	铁建 023A	100,000	10,015,000.00	1.13
3	136249	熙悦 1A2	70,000	6,997,200.00	0.79
4	136139	臻林 02A1	50,000	5,015,000.00	0.56
5	193256	明远 03A3	50,000	5,000,000.00	0.56
6	189767	明远 01A3	50,000	4,996,000.00	0.56
7	193154	烨熠 3A1	50,000	4,994,000.00	0.56
8	193155	烨熠 3A2	50,000	4,983,500.00	0.56
9	136381	晨煜 4A1	50,000	4,412,000.00	0.50

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 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	2,956.95
2	应收证券清算款	21,000,000.00
3	应收股利	—
4	应收利息	21,565,069.79
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	42,568,026.74

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	权益投资	—	—
	其中：股票	—	—
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	1,041,873,400.00	95.32
	其中：债券	1,011,435,900.00	92.54
	资产支持证券	30,437,500.00	2.78
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	5,952,517.96	0.54
8	其他资产	45,152,127.63	4.13
9	合计	1,092,978,045.59	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 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	358,939,000.00	40.32
	其中：政策性金融债	40,090,000.00	4.50
4	企业债券	129,268,400.00	14.52
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	523,228,500.00	58.78
7	可转债（可交换债）	—	—
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	1,011,435,900.00	113.62

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	102000114	20 华电 MTN001A	600,000	60,594,000.00	6.81
2	102002077	20 华侨城 MTN006	500,000	51,440,000.00	5.78
3	101674010	16 鲁高速集 MTN002	500,000	50,370,000.00	5.66
4	101659049	16 皖交控 MTN003	500,000	50,365,000.00	5.66
5	2028017	20 农业银行	500,000	50,115,000.00	5.63

		永续债 01			
--	--	--------	--	--	--

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	137657	中铁 8 优 A	100,000	10,065,000.00	1.13
2	189304	铁建 023A	100,000	10,042,000.00	1.13
3	136139	臻林 02A1	50,000	5,016,500.00	0.56
4	189767	明远 01A3	50,000	5,000,000.00	0.56
5	169924	惠沣 4A1	100,000	314,000.00	0.04

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 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	2,940.50
2	应收证券清算款	28,000,000.00
3	应收股利	—
4	应收利息	17,143,790.13
5	应收申购款	5,397.00
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	45,152,127.63

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 6 开放式基金份额变动（转型后）

单位：份

项目	工银信用纯债三个月定期开 债券 A	工银信用纯债三个月定期开 债券 C
基金合同生效日(2021 年 8 月 3 日)基金 份额总额	618,844,315.46	4,358,558.90
基金合同生效日起至报告期期末基金总 申购份额	—	—
减：基金合同生效日起至报告期期末基 金总赎回份额	—	8,460.24
基金合同生效日起至报告期期末基金拆 分变动份额（份额减少以“-”填列）	—	—
报告期期末基金份额总额	618,844,315.46	4,350,098.66

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	工银信用纯债两年定期开债 券 A	工银信用纯债两年定期开债 券 C
报告期期初基金份额总额	625,684,911.75	7,041,570.48

报告期期间基金总申购份额	206,074.12	25,620.03
减:报告期期间基金总赎回份额	7,046,670.41	2,708,631.61
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	618,844,315.46	4,358,558.90

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情况（转型前）

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。

§ 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

工银瑞信信用纯债两年定期开放债券型证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会，于 2021 年 7 月 5 日表决通过了《关于工银瑞信信用纯债两年定期开放债券型证券投资基金变更相关事项的议案》。自 2021 年 8 月 3 日起，工银瑞信信用纯债两年定期开放债券型证券投资基金更名为工银瑞信信用纯债三个月定期开放债券型证券投资基金，《工银瑞信信用纯债三个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》、《工银瑞信信用纯债三个月定期开放债券型证券投资基金托管协议》生效，原《工银瑞信信用纯债两年定期开放债券型证券投资基金基金合同》、《工银瑞

信信用纯债两年定期开放债券型证券投资基金托管协议》自同一日起失效。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信用纯债两年定期开放债券型证券投资基金变更注册的文件；
- 2、《工银瑞信信用纯债三个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《工银瑞信信用纯债三个月定期开放债券型证券投资基金托管协议》；
- 4、《工银瑞信信用纯债三个月定期开放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

2021 年 10 月 27 日