

工银瑞信添颐债券型证券投资基金 2022 年第 1 季度报告

2022 年 3 月 31 日

基金管理人：工银瑞信基金管理有限公司

基金托管人：中国民生银行股份有限公司

报告送出日期：2022 年 4 月 22 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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 4 月 20 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。

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

| | |
|------------|--|
| 基金简称 | 工银添颐债券 |
| 基金主代码 | 485114 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2011 年 8 月 10 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 1,135,762,409.69 份 |
| 投资目标 | 在保持基金资产流动性与控制基金风险的前提下，力争实现超越业绩比较基准的长期投资回报，为投资者提供养老投资的工具。 |
| 投资策略 | 本基金将在资产配置策略的基础上，通过固定收益类品种投资策略构筑债券组合的平稳收益，通过积极的权益类资产投资策略追求基金资产的增强型回报。 |
| 业绩比较基准 | 五年期定期存款利率+1.5%。 |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，预期收益和风险水平高于货币市场基金，低于混合型基金与股票型基金；因为本基金可以配置二级市场股票，所以预期收益和风险水平高于投资范围不含二级市场股票的债券型基金。 |

| | | |
|-----------------|------------------|------------------|
| 基金管理人 | 工银瑞信基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国民生银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 工银添颐债券 A | 工银添颐债券 B |
| 下属分级基金的交易代码 | 485114 | 485014 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 657,442,094.98 份 | 478,320,314.71 份 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2022 年 1 月 1 日-2022 年 3 月 31 日） | |
|-----------------|-------------------------------------|------------------|
| | 工银添颐债券 A | 工银添颐债券 B |
| 1. 本期已实现收益 | -5,149,609.59 | -5,684,551.36 |
| 2. 本期利润 | -98,934,403.02 | -69,032,429.70 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.1573 | -0.1542 |
| 4. 期末基金资产净值 | 1,706,034,929.92 | 1,165,904,876.03 |
| 5. 期末基金份额净值 | 2.595 | 2.437 |

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

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

工银添颐债券 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 | -5.74% | 0.58% | 1.54% | 0.02% | -7.28% | 0.56% |
| 过去六个月 | -1.96% | 0.46% | 3.12% | 0.02% | -5.08% | 0.44% |
| 过去一年 | 7.41% | 0.43% | 6.25% | 0.02% | 1.16% | 0.41% |
| 过去三年 | 23.57% | 0.45% | 18.75% | 0.02% | 4.82% | 0.43% |

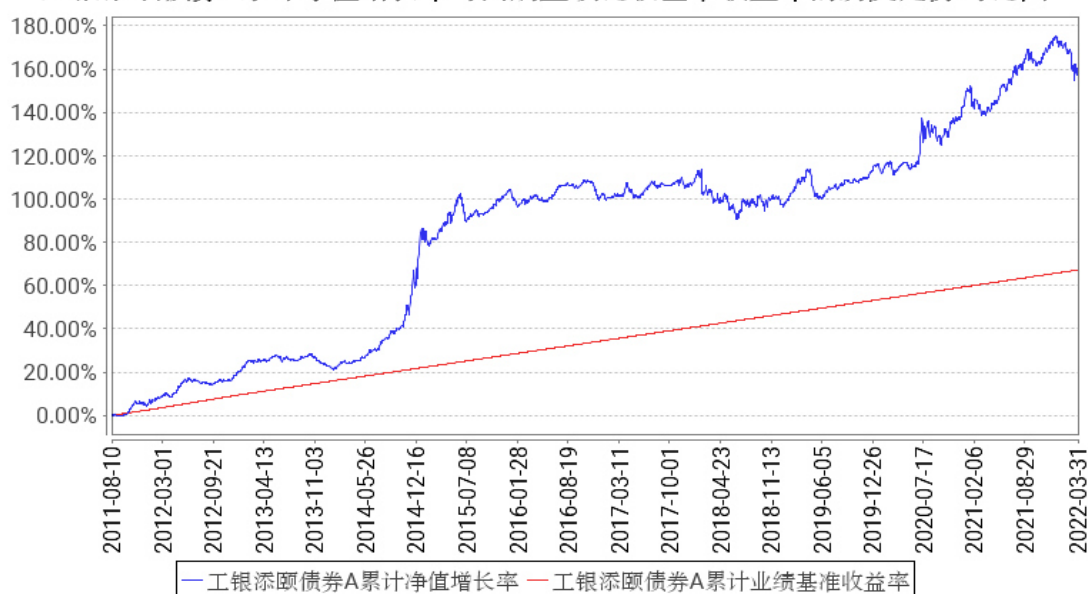
| | | | | | | |
|------------|---------|-------|--------|-------|--------|-------|
| 过去五年 | 28.72% | 0.44% | 31.25% | 0.02% | -2.53% | 0.42% |
| 自基金合同生效起至今 | 159.50% | 0.42% | 67.18% | 0.02% | 92.32% | 0.40% |

工银添颐债券 B

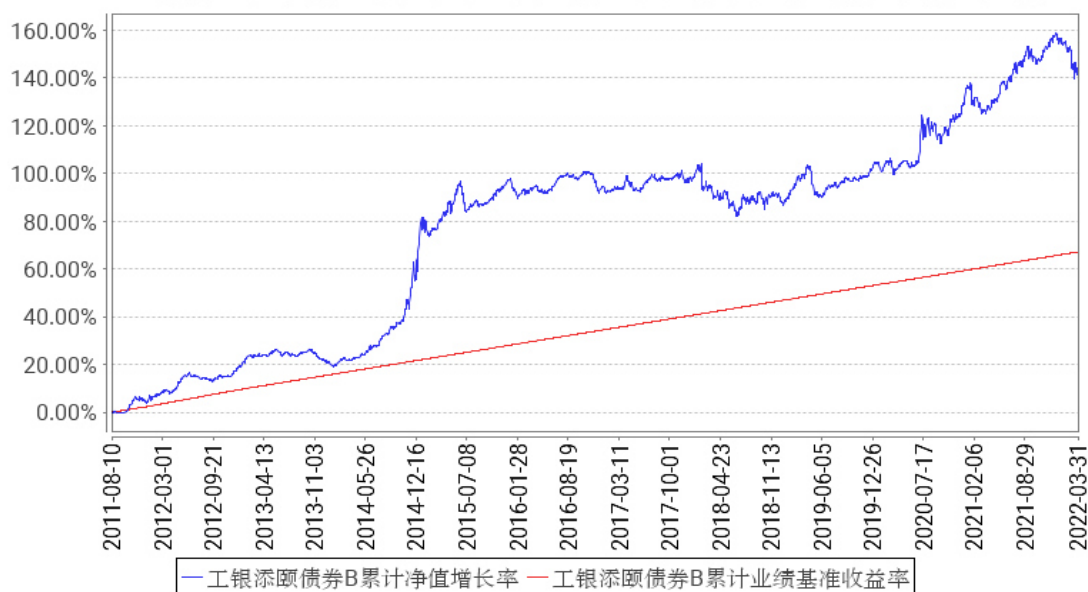
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|---------|-----------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月 | -5.87% | 0.58% | 1.54% | 0.02% | -7.41% | 0.56% |
| 过去六个月 | -2.17% | 0.46% | 3.12% | 0.02% | -5.29% | 0.44% |
| 过去一年 | 6.93% | 0.43% | 6.25% | 0.02% | 0.68% | 0.41% |
| 过去三年 | 21.97% | 0.45% | 18.75% | 0.02% | 3.22% | 0.43% |
| 过去五年 | 25.81% | 0.44% | 31.25% | 0.02% | -5.44% | 0.42% |
| 自基金合同生效起至今 | 143.70% | 0.42% | 67.18% | 0.02% | 76.52% | 0.40% |

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

工银添颐债券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



工银添颐债券B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 2011 年 08 月 10 日生效。

2、根据基金合同规定，本基金建仓期为 6 个月。截至本报告期末，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。

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

| 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 | | |
| 杜海涛 | 副总经理，本基金的基金经理 | 2011年8月10日 | - | 25年 | 先后在宝盈基金管理有限公司担任基金经理助理，招商基金管理有限公司担任招商现金增值基金基金经理；2006年加入工银瑞信，现任公司副总经理，兼任工银瑞信（国际）董事长、基金经理；2006年9月21日至2011年4月21日，担任工银瑞信货币市场基金基金经理；2010年8月16日至2012年1月10日，担任工银瑞信双利债券型证券投资基金基金经理；2012年6月21日至2017年7月19日，担任工银瑞信纯债定期开放债券型证券投资基金基金经理；2013年8月14日至2015年11月11日，担任工银瑞信月薪定期支付债券型证券投资基金基金经理；2007年5月11日至今，担任 |

| | | | | | |
|-----|------------------------------|------------------|---|------|--|
| | | | | | 工银瑞信增强收益债券型证券投资基金基金经理；2011 年 8 月 10 日至今，担任工银瑞信添颐债券型证券投资基金基金经理；2013 年 1 月 7 日至 2020 年 11 月 30 日，担任工银瑞信货币市场基金基金经理；2013 年 10 月 31 日至 2018 年 8 月 28 日，担任工银瑞信添福债券型证券投资基金基金经理；2014 年 1 月 27 日至 2018 年 6 月 5 日，担任工银瑞信薪金货币市场基金基金经理；2015 年 4 月 17 日至 2018 年 6 月 5 日，担任工银瑞信总回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2018 年 2 月 27 日至 2020 年 12 月 29 日，担任工银瑞信信用添利债券型证券投资基金基金经理；2021 年 6 月 18 日至今，担任工银瑞信新财富灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2021 年 11 月 10 日至今，担任工银瑞信稳健瑞盈一年持有期债券型证券投资基金基金经理；2022 年 1 月 26 日至今，担任工银瑞信招瑞一年持有期混合型证券投资基金基金经理。 |
| 景晓达 | 养老金投资中心投资部副总经理、投资总监，本基金的基金经理 | 2018 年 10 月 23 日 | - | 14 年 | 先后在上海绿地集团担任战略部职员，在安信证券股份有限公司担任固定收益分析师；2013 年加入工银瑞信，现任养老金投资中心投资部副总经理、投资总监、债券投资团队负责人、基金经理。2018 年 10 月 23 日至今，担任工银瑞信添颐债券型证券投资基金基金经理；2021 年 5 月 28 日至今，担任工银瑞信聚丰混合型证券投资基金基金经理；2021 年 5 月 28 日至今，担任工银瑞信聚瑞混合型证券投资基金基金经理；2021 年 8 月 24 日至今，担任工银瑞信聚享混合型证券投资基金基金经理；2021 年 8 月 27 日至今，担任工银瑞信聚宁 9 个月持有期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

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，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 4 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

回顾 2021 年年度报告对于 2022 年的展望，当时认为海外经济复苏持续，国内经济工作会议定调“以经济建设为中心”，预计货币政策保持宽松、财政政策更加积极、房地产政策也将边际放松。全年而言，支持性政策可能在经济企稳之后逐步收缩。尽管面临高估值的约束，但仍坚持认为权益市场在稳增长与高质量转型下存在结构性机会。

从过去一个季度的实际情况来看，超预期的是俄乌战争带来的全球风险偏好下降，以及西方国家对于俄罗斯制裁导致的商品价格大幅上涨，进一步加剧了全球尤其是西方主要经济体对通胀的忧虑。另外，国内疫情反复、防疫政策重新收紧对经济的冲击也令市场担忧全年经济增长目标能否实现。国内政策方面，1 月份央行再度下调 LPR 利率，社融放量释放出明确的稳增长信号，但

信用扩张仍受到需求约束、2 月份社融数据明显不及预期，加剧了市场对于后续经济企稳的忧虑。虽然 1-2 月份统计局公布的经济数据整体好于预期，但与金融数据、中观高频数据等存在一定分化。

债券市场方面，收益率先下后上。1 月份延续了去年的牛市行情，各期限国债、政策性金融债券利率水平均出现一定程度下行，后续随着稳增长预期和海外通胀压力的发酵，收益率出现反弹。收益率曲线整体呈现“陡峭化”，高等级信用利差有所扩张。在基本面与交易层面的压力下，银行永续债收益率上行幅度较大。

股票市场方面，经济仍面临压力、稳增长政策力度低于预期，叠加疫情、俄乌战争等影响，出现了较大幅度的调整。其中估值高的成长板块跌幅较大，而受益于能源与大宗商品价格大幅上涨的板块有所上涨，受益于稳增长、低估值的地产、银行与基建等板块表现明显更优。

可转债方面，在去年底高估值的背景下，今年在正股带动以及交易盘抛压下呈现“双杀”局面，转债指数跌幅在 11%左右。

债券方面，本基金在一季度明显降低久期，一方面是因为规模增长的被动下降，另一方面更为重要的是对稳增长和后续经济的企稳抱有信心而主动调降久期水平，目前保持在 1 年左右。

股票方面，本基金维持接近 20%的高仓位，其中以地产、建筑、清洁能源等受益于稳增长的板块为主，另外逐步增持半导体板块、减持部分公用事业板块，其他行业保持基本稳定。

可转债方面，本基金自去年底至 2 月中旬将仓位从 37.5%左右降至 30%左右，其中有规模增长导致的被动调降、也有主动调降。随着 3 月份以来可转债价格的持续大幅下跌，本基金循序渐进增持至 45%左右，重点配置绝对价格跌至 130 元以内、长期看好正股基本面的相关标的。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金 A 份额净值增长率为-5.74%，本基金 A 份额业绩比较基准收益率为 1.54%，本基金 B 份额净值增长率为-5.87%，本基金 B 份额业绩比较基准收益率为 1.54%。

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

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 | 566,012,563.41 | 18.56 |

| | | | |
|---|-------------------|------------------|--------|
| | 其中：股票 | 566,012,563.41 | 18.56 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 2,400,287,597.13 | 78.73 |
| | 其中：债券 | 2,400,287,597.13 | 78.73 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | 60,000,000.00 | 1.97 |
| | 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 | 15,793,693.85 | 0.52 |
| 8 | 其他资产 | 6,771,269.13 | 0.22 |
| 9 | 合计 | 3,048,865,123.52 | 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

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|----------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 270,416,305.77 | 9.42 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 55,149,411.14 | 1.92 |
| E | 建筑业 | 53,420,000.00 | 1.86 |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 13,710,000.00 | 0.48 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 47,231,954.24 | 1.64 |
| J | 金融业 | 9,863,000.00 | 0.34 |
| K | 房地产业 | 96,811,292.26 | 3.37 |
| L | 租赁和商务服务业 | 5,925,000.00 | 0.21 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 13,485,600.00 | 0.47 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 566,012,563.41 | 19.71 |

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。

5.2.2 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

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|-----------|---------------|--------------|
| 1 | 601985 | 中国核电 | 6,800,174 | 55,149,411.14 | 1.92 |
| 2 | 601669 | 中国电建 | 4,000,000 | 29,160,000.00 | 1.02 |
| 3 | 600048 | 保利发展 | 1,400,000 | 24,780,000.00 | 0.86 |
| 4 | 600383 | 金地集团 | 1,600,000 | 22,848,000.00 | 0.80 |
| 5 | 001979 | 招商蛇口 | 1,400,000 | 21,224,000.00 | 0.74 |
| 6 | 002430 | 杭氧股份 | 700,000 | 20,076,000.00 | 0.70 |
| 7 | 600941 | 中国移动 | 300,000 | 20,058,000.00 | 0.70 |
| 8 | 600426 | 华鲁恒升 | 600,000 | 19,542,000.00 | 0.68 |
| 9 | 002460 | 赣锋锂业 | 150,000 | 18,847,500.00 | 0.66 |
| 10 | 002371 | 北方华创 | 65,032 | 17,712,830.08 | 0.62 |

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 | 103,930,579.02 | 3.62 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 891,310,646.01 | 31.04 |
| | 其中：政策性金融债 | 589,568,441.09 | 20.53 |
| 4 | 企业债券 | 27,773,838.90 | 0.97 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | 1,377,272,533.20 | 47.96 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 2,400,287,597.13 | 83.58 |

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 | 210202 | 21 国开 02 | 2,000,000 | 203,035,287.67 | 7.07 |
| 2 | 200202 | 20 国开 02 | 1,500,000 | 152,068,849.32 | 5.29 |
| 3 | 110079 | 杭银转债 | 950,000 | 116,348,998.63 | 4.05 |
| 4 | 2028047 | 20 交通银行 02 | 900,000 | 92,282,671.23 | 3.21 |
| 5 | 127046 | 百润转债 | 752,829 | 85,838,305.10 | 2.99 |

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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 | 302,576.39 |
| 2 | 应收证券清算款 | 6,334,097.92 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 134,594.82 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |

| | | |
|---|----|--------------|
| 8 | 合计 | 6,771,269.13 |
|---|----|--------------|

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|----------------|--------------|
| 1 | 110079 | 杭银转债 | 116,348,998.63 | 4.05 |
| 2 | 128136 | 立讯转债 | 74,289,144.63 | 2.59 |
| 3 | 132009 | 17 中油 EB | 63,026,547.95 | 2.19 |
| 4 | 113616 | 韦尔转债 | 62,170,134.16 | 2.16 |
| 5 | 110076 | 华海转债 | 60,526,163.07 | 2.11 |
| 6 | 110059 | 浦发转债 | 58,052,273.97 | 2.02 |
| 7 | 132015 | 18 中油 EB | 52,051,546.06 | 1.81 |
| 8 | 113042 | 上银转债 | 36,661,004.11 | 1.28 |
| 9 | 110053 | 苏银转债 | 36,315,221.92 | 1.26 |
| 10 | 123091 | 长海转债 | 35,488,289.50 | 1.24 |
| 11 | 127015 | 希望转债 | 34,436,481.91 | 1.20 |
| 12 | 128035 | 大族转债 | 32,572,661.27 | 1.13 |
| 13 | 113584 | 家悦转债 | 29,929,838.80 | 1.04 |
| 14 | 118000 | 嘉元转债 | 27,134,338.68 | 0.94 |
| 15 | 113623 | 凤 21 转债 | 27,134,170.38 | 0.94 |
| 16 | 113011 | 光大转债 | 26,903,938.36 | 0.94 |
| 17 | 127041 | 弘亚转债 | 26,825,506.52 | 0.93 |
| 18 | 127044 | 蒙娜转债 | 24,428,840.13 | 0.85 |
| 19 | 128134 | 鸿路转债 | 23,736,789.81 | 0.83 |
| 20 | 127031 | 洋丰转债 | 22,229,580.82 | 0.77 |
| 21 | 132021 | 19 中电 EB | 21,427,397.26 | 0.75 |
| 22 | 123113 | 仙乐转债 | 19,345,638.25 | 0.67 |
| 23 | 113605 | 大参转债 | 15,374,873.12 | 0.54 |
| 24 | 110055 | 伊力转债 | 14,938,071.23 | 0.52 |
| 25 | 123101 | 拓斯转债 | 12,591,117.10 | 0.44 |
| 26 | 123119 | 康泰转 2 | 11,973,095.89 | 0.42 |
| 27 | 120002 | 18 中原 EB | 11,050,369.67 | 0.38 |
| 28 | 128132 | 交建转债 | 9,539,720.69 | 0.33 |
| 29 | 132018 | G 三峡 EB1 | 8,232,788.87 | 0.29 |
| 30 | 127016 | 鲁泰转债 | 7,874,179.24 | 0.27 |
| 31 | 113044 | 大秦转债 | 6,407,086.28 | 0.22 |
| 32 | 110081 | 闻泰转债 | 5,923,706.85 | 0.21 |
| 33 | 128017 | 金禾转债 | 5,882,893.15 | 0.20 |
| 34 | 123109 | 昌红转债 | 4,581,246.11 | 0.16 |
| 35 | 132014 | 18 中化 EB | 4,145,238.90 | 0.14 |
| 36 | 128117 | 道恩转债 | 2,443,522.29 | 0.09 |
| 37 | 127012 | 招路转债 | 2,369,595.19 | 0.08 |
| 38 | 118002 | 天合转债 | 2,332,637.81 | 0.08 |

| | | | | |
|----|--------|------|--------------|------|
| 39 | 123010 | 博世转债 | 2,190,553.42 | 0.08 |
| 40 | 123104 | 卫宁转债 | 1,593,800.65 | 0.06 |
| 41 | 123107 | 温氏转债 | 11,547.30 | 0.00 |

注：上表包含期末持有的处于转股期的可转换债券和可交换债券明细。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值 (元) | 占基金资产净 值比例 (%) | 流通受限情 况说明 |
|----|--------|------|--------------------|-------------------|--------------|
| 1 | 002371 | 北方华创 | 2,642,830.08 | 0.09 | 非公开流通受限 |

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

单位：份

| 项目 | 工银添颐债券 A | 工银添颐债券 B |
|---------------------------|----------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 444,572,949.93 | 278,675,174.83 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 245,252,798.09 | 315,684,186.03 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 32,383,653.04 | 116,039,046.15 |
| 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 | 657,442,094.98 | 478,320,314.71 |

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

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

无。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准工银瑞信添颐债券型证券投资基金设立的文件；
- 2、《工银瑞信添颐债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《工银瑞信添颐债券型证券投资基金托管协议》；
- 4、《工银瑞信添颐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

2022 年 4 月 22 日