

工银瑞信精选平衡混合型证券投资基金

2012 第四季度 报告

2012年12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：中国建设银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一三年一月十八日

§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法律责任。

基金管理人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2013年1月15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，也不保证基金持有人的本金不受损失或本金增值。

基金的过往业绩并不预示其未来表现，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。

本报告自2012年10月1日起至2013年1月31日止。

§2 基金产品概况	
基金名称	工银瑞信精选平衡混合
交易代码	483003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年7月13日
报告期末基金份额总额	9,826,476,608.91份
投资策略	有效控制投资组合风险，追求稳定收益与长期资本增值。
业绩比较基准	本基金专注基本面研究，遵循系统化、程序化的投资流程以实证决策的科学性与一致性。 60%×沪深300指数收益率+40%×新华富时中国综合指数收益率
风险收益特征	本基金是混合型基金，其预期收益及风险水平介于股票型基金与债券型基金之间，属于中等风险水平基金
基金管理人	工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标	报告期(2012年10月1日～2012年12月31日)
1.本期已实现收益	-522,088,538.47
2.本期利润	88,800,580.55
3.加权平均基金份额本期利润	0.0090
4.期末基金资产净值	5,210,951,996.25
5.期末基金份额净值	0.5301

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.所有数据截止到2012年12月31日。

3.2 基金净值表现

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

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 1.77% 0.99% 6.26% 0.76% -4.49% 0.23%

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

基金投资策略分析：本基金自基金合同生效起六个月内为建仓期，截至报告期末本基金的各类投资组合符合基金合同关于投资范围、投资比例限制与禁止行为的规定；本基金投资资产中基金资产的比例为40%-80%，债券及其它短期金融工具占基金资产净值的比例为20%-60%，本基金持有的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的百分之五，持有的可转债债券不超过基金资产净值的20%，持有的权证市值不超过基金资产净值的3%。

3.3 其他指标

3.3.1 其他指标

3.3.2 其他指标

3.3.3 其他指标

3.3.4 其他指标

3.3.5 其他指标

3.3.6 其他指标

3.3.7 其他指标

3.3.8 其他指标

3.3.9 其他指标

3.3.10 其他指标

3.3.11 其他指标

3.3.12 其他指标

3.3.13 其他指标

3.3.14 其他指标

3.3.15 其他指标

3.3.16 其他指标

3.3.17 其他指标

3.3.18 其他指标

3.3.19 其他指标

3.3.20 其他指标

3.3.21 其他指标

3.3.22 其他指标

3.3.23 其他指标

3.3.24 其他指标

3.3.25 其他指标

3.3.26 其他指标

3.3.27 其他指标

3.3.28 其他指标

3.3.29 其他指标

3.3.30 其他指标

3.3.31 其他指标

3.3.32 其他指标

3.3.33 其他指标

3.3.34 其他指标

3.3.35 其他指标

3.3.36 其他指标

3.3.37 其他指标

3.3.38 其他指标

3.3.39 其他指标

3.3.40 其他指标

3.3.41 其他指标

3.3.42 其他指标

3.3.43 其他指标

3.3.44 其他指标

3.3.45 其他指标

3.3.46 其他指标

3.3.47 其他指标

3.3.48 其他指标

3.3.49 其他指标

3.3.50 其他指标

3.3.51 其他指标

3.3.52 其他指标

3.3.53 其他指标

3.3.54 其他指标

3.3.55 其他指标

3.3.56 其他指标

3.3.57 其他指标

3.3.58 其他指标

3.3.59 其他指标

3.3.60 其他指标

3.3.61 其他指标

3.3.62 其他指标

3.3.63 其他指标

3.3.64 其他指标

3.3.65 其他指标

3.3.66 其他指标

3.3.67 其他指标

3.3.68 其他指标

3.3.69 其他指标

3.3.70 其他指标

3.3.71 其他指标

3.3.72 其他指标

3.3.73 其他指标

3.3.74 其他指标

3.3.75 其他指标

3.3.76 其他指标

3.3.77 其他指标

3.3.78 其他指标

3.3.79 其他指标

3.3.80 其他指标

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	3,518,913,451.64	66.30
	其中:股票	3,518,913,451.64	66.30
2	固定收益投资	1,004,171,604.00	18.92
	其中:债券	1,004,171,604.00	18.92
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	520,920,989.16	9.82
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	200,456,191.92	3.78
6	其他资产	62,805,515.86	1.18
7	合计	5,307,267,752.58	100.00

注：由于四舍五入的原因金额与基金总资产的比例分母之和与合计可能有尾差。

§2 报告期末按行业分类的股票投资组合

B	采矿业	7,761,020.20	0.15
C	制造业	1,730,697,518.73	33.21
C0	食品、饮料	1,161,651,328.32	22.29
C1	纺织、服装、皮毛	57,343,181.10	1.10
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	18,127.27	0.00
C5	电子	61,458,652.16	1.18
C6	金属、非金属	9,197,357.68	0.18
C7	机械、设备、仪表	270,884,319.89	5.20
C8	医药、生物制品	170,143,922.71	3.27
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	161,328,812.73	3.10
E	建筑业	17,519,901.00	0.34
F	交通运输、仓储业	1,286,305.20	0.02
G	信息技术业	3,715,618.71	0.07
H	批发和零售业	79,764,276.00	1.53
I	金融、保险业	733,918,347.52	14.08
J	房地产业	512,436,181.10	9.83
K	社会服务业	253,519,911.47	4.87
L	传播与文化产业	499.50	0.00
M	综合类	4,805,789.96	0.09

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

§3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	600899	贵州茅台	10,092,993	420,474,088.38	8.07
2	600519	贵州茅台	1,319,551	275,812,550.02	5.29
3	000858	五粮液	8,683,283	245,129,079.09	4.70
4	000568	泸州老窖	5,382,566	190,542,836.40	3.66
5	300015	爱尔眼科	9,806,776	166,813,259.76	3.20
6	600015	华夏银行	16,046,780	166,084,173.00	3.19
7	600048	保利地产	10,799,457	146,872,615.20	2.82
8	000816	江铃动力	23,582,500	128,288,800.00	2.46
9	000939	凯迪电力	18,689,688	124,913,915.84	2.40
10	600000	浦发银行	10,837,817	107,511,144.64	2.06

§4 报告期末按投资组合品种分类的债券投资组合

1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	320,987,000.00	6.16
	其中：政策性金融债	320,987,000.00	6.16
4	企业债券	184,510,504.00	3.54
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	433,676,000.00	8.32
7	可转债	64,998,100.00	1.25
8	其他	-	-
9	合计	1,004,171,604.00	19.27

注：由于四舍五入的原因导致公允价值基金资产净值比例之和与合计占净值略有误差

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

§5 报告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

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	120328	12国债38	2,500,000	249,650,000.00	4.79
2	102059	10中债国债MTN2	800,000	79,456,000.00	1.52
3	108095	10中债国债MTN2	800,000	79,080,000.00	1.52
4	110253	11国债33	700,000	71,337,000.00	1.37
5	128374	12中债国债MTN2	600,000	60,318,000.00	1.16

§6 报告期末按公允价值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	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,318,799.55
2	应收证券清算款	46,317,956.24
3	应收股利	-
4	应收利息	14,118,664.54
5	应收申购款	50,095.53
6	其他应收款	-
7	预付款项	-
8	其他	-
9	合计	62,805,515.86

§7 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	110018	国电转债	49,561,600.00	0.95
2	110015	石化转债	15,436,500.00	0.30

§8 报告期末持有的公允价值高于成本的交易性金融资产

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,318,799.55
2	应收证券清算款	46,317,956.24
3	应收股利	-
4	应收利息	14,118,664.54
5	应收申购款	50,095.53
6	其他应收款	-
7	预付款项	-
8	其他	-
9	合计	62,805,515.86

§9 报告期末持有的公允价值高于成本的交易性金融资产

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,318,799.55
2	应收证券清算款	46,317,956.24
3	应收股利	-
4	应收利息	14,118,664.54
5	应收申购款	50,095.53
6	其他应收款	-
7	预付款项	-
8	其他	-
9	合计	62,805,515.86

§10 报告期末持有的公允价值高于成本的交易性金融资产

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,318,799.55
2	应收证券清算款	46,317,956.24
3	应收股利	-
4	应收利息	14,118,664.54
5	应收申购款	50,095.53
6	其他应收款	-
7	预付款项	-
8	其他	-
9	合计	62,805,515.86

§11 报告期末持有的公允价值高于成本的交易性金融资产

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,318,799.55
2	应收证券清算款	46,317,956.24
3	应收股利	-
4	应收利息	14,118,664.54
5	应收申购款	50,095.53
6	其他应收款	-
7	预付款项	-
8	其他	-
9	合计	62,805,515.86

§12 报告期末持有的公允价值高于成本的交易性金融资产

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,318,799.55
2	应收证券清算款	46,317,956.24
3	应收股利	-
4	应收利息	14,118,664.54
5	应收申购款	50,095.53
6	其他应收款	-
7	预付款项	-
8	其他	-
9	合计	62,805,515.86

§13 报告期末持有的公允价值高于成本的交易性金融资产

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,318,799.55
2	应收证券清算款	46,317,956.24
3	应收股利	-
4	应收利息	14,118,664.54
5	应收申购款	50,095.53
6	其他应收款	-
7	预付款项	-
8	其他	-
9	合计	62,805,515.86

§14 报告期末持有的公允价值高于成本的交易性金融资产

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,318,799.55
2	应收证券清算款	46,317,956.24
3	应收股利	-
4	应收利息	14,118,664.54
5	应收申购款	50,095.53
6	其他应收款	-
7	预付款项	-
8	其他	-
9	合计	62,805,515.86

§15 报告期末持有的公允价值高于成本的交易性金融资产

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,318,799.55
2	应收证券清算款	46,317,956.24
3	应收股利	-
4	应收利息	14,118,664.54
5	应收申购款	50,095.53
6	其他应收款	-
7	预付款项	-
8	其他	-
9	合计	62,805,515.86

§16 报告期末持有的公允价值高于成本的交易性金融资产

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,318,799.55
2	应收证券清算款	46,317,956.24
3	应收股利	-
4	应收利息	14,118,664.54
5	应收申购款	50,095.53</