



信息披露 Disclosure

工银瑞信精选平衡混合型证券投资基金

2012 年第四季度 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、监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、完整性、及时性承担个别及连带责任。

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，确认复核结果不存在虚假记载、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。投资人投资于基金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2012年10月1日起至2012年12月31日止。

基金简称	
交易代码	
基金份额总额	
基金合同生效日	
报告期末基金份额总额	
投资目标	
投资策略	
业绩比较基准	
风险收益特征	
基金管理人	
基金托管人	
\$3 主要财务指标和基金净值表现	
3.1 主要财务指标	
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	0.0000
4.期末基金份额净值	5,10,951,996.25
5.期末基金份额净值	0.5303

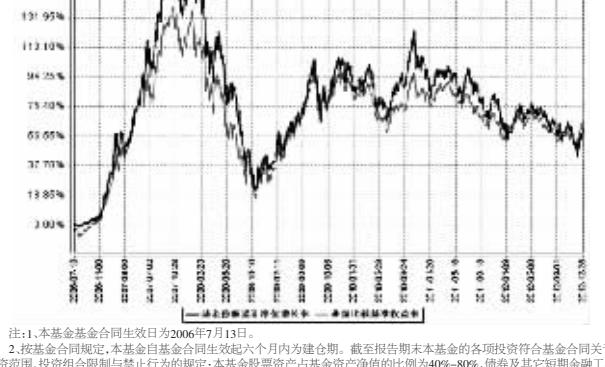
注1:上表基金净值指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计算费用后实际收益水平将低于所列数字。 2.本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益,其他收入不含公允价值变动收益扣除相关费用后的余额;本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。 3.所列数据截止至2012年12月31日。	

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

阶段	净值增长(%)	净值增长标准差(%)	业绩比较基准收益(%)	业绩比较基准收益标准差(%)	(1)-(3)	(2)-(4)
过去三个月	1.77%	0.99%	6.26%	0.76%	-4.49%	0.23%

3.2.2 基金合同生效以来基金净值增长率变化及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注1:本基金合同生效日为2006年7月13日。

2.按基金合同规定,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项投资比例已达到基金合同关于投资范围、投资比例的有关规定,并经托管人复核。

3.本基金合同规定的最低赎回金额为人民币100元,赎回时所收取的费用不低于基金财产净值的2%,持有的权证总市值不能低于基金财产净值的3%。

3.3 其他指标

4. 管理人报告

姓名	职务	任本基金的基金经理期限	证券从业年限	说明
曲丽	本基金的基本基金经理	2007年11月12日	-	11
杨军	本基金基金经理	2012年12月17日	-	15

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金报告期内,本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价日间反向交易成交较少的股票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日间反向交易成交较少的股票未出现异常交易的情况有一次。投资组合因投资策略而发生同日反向交易,未出现不公平对待不同投资者的情况。

4.4 报告期内基金的经营情况说明

2012年度本基金仍继续保持较好的业绩,在机制上进行了调整,经过我们的研究认为企业基本的回报率是良好的长期投资的回报率,所以对企业的投资比例进行调整。

4.5 管理人对宏观经济的专项说明

本基金报告期内未发现宏观经济存在异常波动的情况。本报告期内,本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价日间反向交易成交较少的股票未出现异常交易的情况有一次。投资组合因投资策略而发生同日反向交易,未出现不公平对待不同投资者的情况。

4.6 报告期内基金的估值政策说明

本基金的估值政策遵循《基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金会计核算办法》等法律法规的规定。

4.7 管理人对宏观经济的专项说明

本基金的估值政策遵循《基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金会计核算办法》等法律法规的规定。

4.8 报告期内基金的费用计提、回收情况

本基金的费用计提、回收情况遵循《基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金会计核算办法》等法律法规的规定。

4.9 报告期内基金的利润分配情况

本基金的利润分配遵循《基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金会计核算办法》等法律法规的规定。

4.10 报告期内基金的客户服务情况

本基金的客户服务遵循《基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金会计核算办法》等法律法规的规定。

4.11 报告期内基金的投诉情况

本基金的投诉情况遵循《基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金会计核算办法》等法律法规的规定。

4.12 报告期内基金的交易价格波动情况

本基金的交易价格波动情况遵循《基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金会计核算办法》等法律法规的规定。

4.13 报告期内基金的异常情况

本基金的异常情况遵循《基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金会计核算办法》等法律法规的规定。

4.14 报告期内基金的流动性风险揭示

本基金的流动性风险揭示遵循《基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金会计核算办法》等法律法规的规定。

4.15 报告期内基金的声誉风险揭示

本基金的声誉风险揭示遵循《基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金会计核算办法》等法律法规的规定。

4.16 报告期内基金的其他风险揭示

本基金的其他风险揭示遵循《基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金会计核算办法》等法律法规的规定。

4.17 报告期内基金的其他重要信息

本基金的其他重要信息遵循《基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金会计核算办法》等法律法规的规定。

4.18 投资组合报告

5. 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

5.2 报告期末基金份额净值表现

5.3 主要财务指标

5.4 主要财务指标

5.5 主要财务指标

5.6 主要财务指标

5.7 主要财务指标

5.8 主要财务指标

5.9 主要财务指标

5.10 主要财务指标

5.11 主要财务指标

5.12 主要财务指标

5.13 主要财务指标

5.14 主要财务指标

5.15 主要财务指标

5.16 主要财务指标

5.17 主要财务指标

5.18 主要财务指标

5.19 主要财务指标

5.20 主要财务指标

5.21 主要财务指标

5.22 主要财务指标

5.23 主要财务指标

5.24 主要财务指标

5.25 主要财务指标

5.26 主要财务指标

5.27 主要财务指标

5.28 主要财务指标

5.29 主要财务指标

5.30 主要财务指标

5.31 主要财务指标

5.32 主要财务指标

5.33 主要财务指标

5.34 主要财务指标

5.35 主要财务指标

5.36 主要财务指标

5.37 主要财务指标

5.38 主要财务指标

5.39 主要财务指标

5.40 主要财务指标

5.41 主要财务指标

5.42 主要财务指标

5.43 主要财务指标

5.44 主要财务指标

5.45 主要财务指标

5.46 主要财务指标

5.47 主要财务指标

5.48 主要财务指标

5.49 主要财务指标

5.50 主要财务指标

5.51 主要财务指标

5.52 主要财务指标

5.53 主要财务指标

5.54 主要财务指标

5.55 主要财务指标

5.56 主要财务指标

5.57 主要财务指标

5.58 主要财务指标

5.59 主要财务指标

5.60 主要财务指标

5.61 主要财务指标

5.62 主要财务指标

5.63 主要财务指标

5.64 主要财务指标

5.65 主要财务指标

5.66 主要财务指标

5.67 主要财务指标

5.68 主要财务指标

5.69 主要财务指标

5.70 主要财务指标

5.71 主要财务指标

5.72 主要财务指标