工银瑞信7天理财债券型证券投资基金

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,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2012年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	工银7天理财债券	
交易代码	485118	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012年8月22日	
报告期末基金份额总额	27,106,523,552.66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	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	中国建设银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	工银7天理财债券A	工银7天理财债券B
下属两级基金的交易代码	485118	485018
报告期末下属两级基金的份额总额	20,686,670,580.80份	6,419,852,971.86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(2012年10月1日 - 2012年12月31日)	
	工银7天理财债券A	工银7天理财债券B
1. 本期已实现收益	219,017,488.50	73,437,141.83
2.本期利润	219,017,488.50	73,437,141.83
3.期末基金资产净值	20,686,670,580.80	6,419,852,971.86

注:①)本基金收益分配是按日结转份额。
②)所列数据截止到2012年12月31日。
③)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。
④)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。
⑤)本基金基金合同生效日为2012年8月22日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

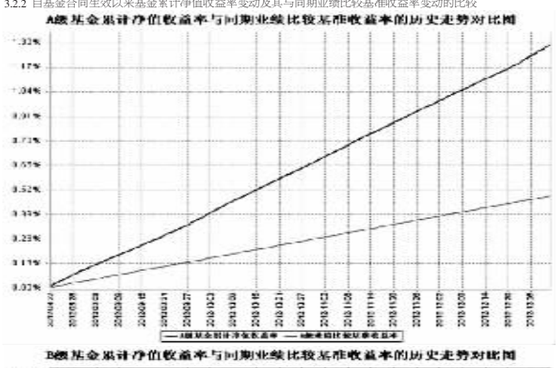
工银7天理财债券A

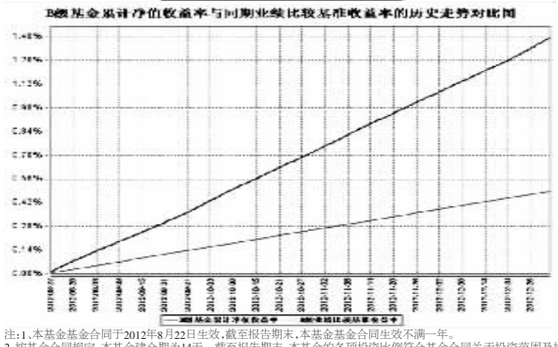
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.9175%	0.0008%	0.3403%	0.0000%	0.5772%	0.0008%

工银7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	0.9911%	0.0008%	0.3403%	0.0000%	0.6508%	0.0008%

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





注:1.本基金基金合同于2012年8月22日生效,截至报告期末,本基金基金合同生效不满一年。
2.按基金合同规定,本基金建仓期为14天。截至报告期末,本基金的各项投资比例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。

§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		
魏欣	本基金的基金经理	2012年8月22日	-	7	2005年加入工银瑞信,曾任债券交易员、固定收益研究员;2011年4月20日起至今担任工银货币市场基金基金经理,2012年8月22日起至今担任工银瑞信7天理财债券型基金基金经理;2012年10月26日起至今担任工银瑞信14天理财债券型基金的基金经理。

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》、《基金管理公司特定客户资产管理业务试点办法》、《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,拟定了《公平交易管理办法》、《异常交易管理办法》,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%的情况有一次。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 报告期内基金的业绩表现

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

四季度内外需均企稳,国内经济增速明显回升;物价水平则维持在较低的水平,CPI屡屡低于市场预期水平;基本面整体情况向好。

货币政策维持中性,央行仍然通过在公开市场操作中投放短期逆回购的方式来调节市场流动性,至年末公开市场操作中逆回购余额为4980亿元。

受到公开市场操作逆回购投放节奏和财政存款上缴时间错配的影响,市场资金短期利率在10月末出现了大幅上行,随着公开市场操作逆回购规模持续稳定在较高水平,11月以后市场资金面维持宽裕,资金利率维持平稳。定期存款利率受到资金面和银行报表时点的影响,10月末和12月末均出现阶段性高点。信用产品方面,高等级短融供给持续较大的影响,高等级短融收益率略微上行,从季初到季末最后一周,AAA级别利率上行了25bp;但是随着经济增速的回稳,债券市场投资者信用偏好明显上升,中低评级短融收益率维持平稳,没有出现受年末因素大幅走高的情况。至季末,中高等级短融间的信用利差明显收窄,AAA和AA级别短融收益率分别至4.45%和4.85%。

本基金仍然坚持通过对客户需求和货币市场的判断,合理安排组合内生现金流的方式来平衡组合流动性与收益,进行适当的期限管理。随着建仓期的完成,本基金在四季度增加了信用产品的持仓比例,同时下调了定期存款的配置比例,组合平均剩余期限有明显增加。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内,工银7天理财A净值增长率0.9175%,工银7天理财B净值增长率0.9911%,业绩比较基准收益率为0.3403%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2013年一季度,国内经济增速同比温和回升;物价水平由于春节错位的因素将出现小幅波动,但是整体仍维持在温和水平,月度CPI同比将维持在3%以内。货币政策将继续保持稳健,预计主要通过公开市场操作逆回购的方式投放流动性,下调准备金率的可能性不能排除。

市场资金方面,货币市场利率将以公开市场操作逆回购为标杆,市场资金面在一季度将维持平稳,但在春节时点和季末需要重点关注市场流动性;在信用产品方面,我们认为目前收益率水平上短融收益率有望在年初出现明显下行;由于信用利差已经较窄相对低评级短融,中高等级短期融资券具备较好的配置价值。另外,短期定期存款可以给组合提供较好的静态收益水平,仍然是短期理财基金较好的投资对象。

四季度,工银7天理财基金将保持中高等级短期融资券的持仓占比,重点做好组合内生现金流的安排,灵活把握市场需求与组合流动性进行期限管理。春节时点和季末将是我们本季度内重要的资产配置时点。我们希望理财基金能将客户的资金积少成多,聚沙成塔,累积资金规模优势增加谈判能力,同时结合我们的对市场走势的判断积极管理组合,使客户在利率市场化的进程中分享到稳定收益。

§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	固定收益投资	4,110,295,417.28	14.92
	其中:债券	4,110,295,417.28	14.92
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	144,700,000.00	0.53
	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	21,066,490,163.23	76.49
4	其他资产	2,219,254,695.73	8.06
5	合计	27,540,740,276.24	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 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	0.90	
	其中:买断式回购融资	0.00	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	270,999,373.50	1.00
	其中:买断式回购融资	-	-

注:报告期内债券融资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余额比例的简单平均值。

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基金资产净值的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	125
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	126
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	48

报告期内投资组合平均剩余期限超过127天情况说明

本报告期内无投资组合平均剩余期限超过127天情况。

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	14.72	1.53
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	36.56	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-180天	31.10	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	11.03	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	93.41	1.53

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	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	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	4,110,295,417.28	15.16
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	4,110,295,417.28	15.16
9	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。

5.5 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	041251040	12中冶CP003	2,500,000	250,101,632.52	0.92
2	011214004	12中粮SCP004	1,500,000	150,003,098.48	0.55
3	011211002	12大唐集SCP002	1,400,000	139,883,807.49	0.52
4	041251031	12百联集CP002	1,200,000	120,069,878.66	0.44
5	041272003	12甘公投CP001	1,000,000	100,006,374.02	0.37
6	041261041	12国电集CP004	1,000,000	100,002,744.60	0.37
7	041260084	12大装备CP002	1,000,000	99,996,966.03	0.37
8	041253028	12中粮CP002	1,000,000	99,992,402.41	0.37
9	011214003	12中粮SCP003	1,000,000	99,985,217.52	0.37
10	011210006	12中电投SCP006	1,000,000	99,972,112.81	0.37

注:上表中,债券的成本包括债券面值和折溢价。

5.6 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	-
报告期内偏离度的最高值	0.0170%
报告期内偏离度的最低值	0.0049%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0106%

注:上表中"偏离情况"根据报告期内各工作日数据计算。

5.7 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1

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1.00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。

5.8.2

本报告期内,本基金持有的剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本总计在每个交易日均未超过日基金资产净值20%。

5.8.3 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。

5.8.4 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	57,402,453.22
4	应收申购款	2,161,852,242.51
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	2,219,254,695.73

5.8.5 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7天理财债券A	工银7天理财债券B
本报告期期初基金份额总额	21,460,103,367.88	5,605,535,926.23
本报告期基金总申购份额	47,932,210,290.91	27,461,630,169.11
减:本报告期基金总赎回份额	48,705,643,077.99	26,647,313,123.48
本报告期期末基金份额总额	20,686,670,580.80	6,419,852,971.86

注:本基金基金合同生效日为2012年8月22日。

§7 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会批准工银瑞信7天理财债券型证券投资基金设立的文件;
2、《工银瑞信7天理财债券型证券投资基金基金合同》;
3、《工银瑞信7天理财债券型证券投资基金托管协议》;
4、基金管理人业务资格批件和营业执照;
5、基金托管人业务资格批件和营业执照;
6、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

8.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的办公场所。

8.3 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。

工银瑞信睿智深证100指数分级证券投资基金

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:中国民生银行股份有限公司
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。

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2012年10月25日(基金合同生效日)起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	工银深证100指数分级		
交易代码	164811		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2012年10月25日		
报告期末基金份额总额	113,751,052.68份		
投资目标	采用指数化投资,通过控制基金投资组合相对于标的指数的偏离度,实现对标的指数的有效跟踪。通过产品分级设置,为不同份额投资者提供具有差异化收益和风险特征的投资工具。		
投资策略	本基金采取完全复制策略,即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但因特殊情况(如市场流动性不足,成分股被限制投资等)导致基金无法获得足够数量的股票时,基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合,追求尽可能贴近目标指数的表现。本基金对标的指数的跟踪目标是,力争使得基金日收益率与业绩比较基准日收益率偏离度的年度平均值不超过0.35%,偏离度年化标准差不超过4%。		
业绩比较基准	深证100指数收益率×95%+商业银行税后活期存款利率×5%		
风险收益特征	本基金属于股票型基金,其风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。此外,本基金作为指数型基金,采用完全复制策略,跟踪标的指数市场表现,目标为获取市场平均收益,是股票基金中处于中等风险水平的基金产品。本基金的分级设定则决定了不同份额具有不同的风险和收益特征。深证100A份额具有低风险、低预期收益的特征;深证100B份额具有高风险、高预期收益的特征。		
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		
下属三级基金简称	工银100A	工银100B	工银100
下属三级基金交易代码	150112	150113	164811
下属三级基金报告期末基金份额总额	24,407,145.00份	24,407,146.00份	64,936,761.68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(2012年10月25日 - 2012年12月31日)
1.本期已实现收益	-4,741,539.75
2.本期利润	2,807,226.90
3.加权平均基金份额本期利润	0.0117
4.期末基金资产净值	120,454,813.99
5.期末基金份额净值	1.0589

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)所列数据截止到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	5.89%	1.27%	4.88%	1.34%	1.01%	-0.07%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

注:1.本基金基金合同于2012年10月25日生效,截至报告期末,本基金基金合同生效不满一年。
2.按基金合同规定,本基金建仓期为6个月。建仓期满,本基金的各项投资比例应符合基金合同关于投资范围、投资禁止行为与限制的规定:本基金投资于标的指数成份股票及其备选成份股票的资产比例不低于基金资产净值的90%;任何交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

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		
何江	指数投资部副总监,本基金基金经理。	2012年10月25日	-	7	先后在北京方通信融科技有限公司担任高级分析师,金诚信用评估有限公司担任分析师。2005年加入工银瑞信,现任指数投资部副总监,曾任风险管理部投资风险管理业务主管;2011年5月25日至今担任工银沪深300基金、工银上证央企ETF基金、工银深证红利ETF基金、工银深证红利ETF联接基金的基金经理;2012年1月31日至今担任工银中证500基金的基金经理;2012年10月25日至今担任工银深证100指数投资基金的基金经理。

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》、《基金管理公司特定客户资产管理业务试点办法》、《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,拟定了《公平交易管理办法》、《异常交易管理办法》,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%的情况有一次。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 报告期内基金的业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本报告期内,基金净值增长相对于业绩比较基准的偏离主要来自于建仓过程中的股票仓位因素,其他影响因素还包括申购赎回、成份股票停牌等。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金净值增长率为5.89%,业绩比较基准收益率为4.88%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金为指数型基金,基金管理人将继续按照基金合同的要求,坚持指数化投资策略,通过运用定量分析等技术,分析和应对导致基金跟踪误差的因素,继续努力将基金的跟踪误差控制在较低水平。

§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	111,182,090.34	89.53
	其中:股票	111,182,090.34	89.53
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	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	9,554,281.51	7.69
6	其他资产	3,451,770.04	2.78
7	合计	124,188,141.89	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 报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合

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	765,764.98	0.64
B	采掘业	7,429,715.30	6.17
C	制造业	60,680,852.20	50.38
C0	食品、饮料	13,293,941.98	11.04
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	3,457,090.00	2.87
C5	电子	4,835,711.73	4.01
C6	金属、非金属	12,192,493.06	10.12
C7	机械、设备、仪表	20,485,979.16	17.01
C8	医药、生物制品	6,415,636.27	5.33
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	879,086.08	0.73
E	建筑业	1,090,155.30	0.91
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	2,052,270.00	1.70
H	批发和零售贸易	3,544,311.10	2.94
I	金融、保险业	12,164,571.82	10.10
J	房地产业	15,527,418.54	12.89
K	社会服务业	3,380,272.27	2.81
L	传播与文化产业	1,772,355.05	1.47
M	综合类	1,895,317.70	1.57
	合计	111,182,090.34	92.30

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 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

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

5.3.1 报告期末指数投资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	000002	万 科A	931,945	9,897,255.90	8.22
2	000651	格力电器	220,915	5,633,332.50	4.68
3	000858	五 粮 液	174,860	4,936,297.80	4.10
4	000001	平安银行	256,323	4,106,294.46	3.41
5	000157	中联重科	400,800	3,691,368.00	3.06
6	002024	苏宁电器	420,494	2,796,285.10	2.32
7	000776	广发证券	162,646	2,508,001.32	2.08
8	000069	华侨城A	322,195	2,416,462.50	2.01
9	000568	泸州老窖	68,025	2,408,085.00	2.00
10	000338	潍柴动力	87,008	2,202,172.48	1.83

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

无。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 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

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 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

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名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 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。

5.8.2 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。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	3,447,280.21
3	应收股利	-
4	应收利息	4,489.83
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,451,770.04

5.8.4 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。

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.1 报告期末指数投资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	000002	万科A	9,897,255.90	8.22	重大事项

5.8.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

5.8.6 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100A	工银100B	工银100
基金合同生效日(2012年10月25日)基金份额总额	105,074,269.00	105,074,270.00	260,760,462.94
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	-	-	1,810,403.55
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-	-	358,968,352.81
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-80,667,124.00	-80,667,124.00	161,334,248.00
本报告期期末基金份额总额	24,407,145.00	24,407,146.00	64,936,761.68

注:拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换份额,报告期末基金份额总额为三级份额之和。

§7 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会批准工银瑞信睿智深证100指数分级证券投资基金设立的文件;
2、《工银瑞信睿智深证100指数分级证券投资基金基金合同》;
3、《工银瑞信睿智深证100指数分级证券投资基金托管协议》;
4、基金管理人业务资格批件和营业执照;
5、基金托管人业务资格批件和营业执照;
6、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

8.2 存放地点

基金管理人或基金托管人住所。

8.3 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。

工银瑞信纯债定期开放债券型证券投资基金

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:交通银行股份有限公司
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。

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2012年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	工银纯债定期开放债券
交易代码	164810
基金运作方式	上市契约型开放式(LOF)
基金合同生效日	2012年6月21日
报告期末基金份额总额	4,808,809,476.50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	本产品的主要投资策略包括:期限配置策略、类属配置策略、期限结构策略及证券选择策略,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	三年期银行定期存款税后收益率。三年期定期存款利率是指每年的第一个工作日中国人民银行网站上发布的三年期"金融机构人民币存款基准利率"。
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	交通银行股份有限公司

§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(2012年10月1日 - 2012年12月31日)
1.本期已实现收益	28,440,925.11
2.本期利润	39,361,112.16
3.加权平均基金份额本期利润	0.0082
4.期末基金资产净值	4,819,983,471.02
5.期末基金份额净值	1.002

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)所列数据截止到2012年12月31日。

3.2 基金净值表现