工银瑞信信用添利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	工银添利债券	
交易代码	485107	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2008年4月14日	
报告期末基金份额总额	2,902,406,250.25份	
投资目标	在控制风险与保持资产流动性的基础上,追求基金资产的长期稳定增值。	
投资策略	本基金将采取利率策略、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	80%×中债企业债总指数+20%×中债国债总指数	
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于低风险基金产品,其长期平均风险和预期收益率低于混合型基金,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	中国建设银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	工银添利债券A	工银添利债券B
下属两级基金的交易代码	485107	485007
报告期末下属两级基金的份额总额	1,812,608,575.40份	1,089,797,674.85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)	
	工银添利债券A	工银添利债券B
1.本期已实现收益	47,531,340.74	28,038,801.94
2.本期利润	39,086,277.50	22,066,909.29
3.加权平均基金份额本期利润	0.0197	0.0181
4.期末基金资产净值	1,904,491,062.03	1,139,902,577.05
5.期末基金份额净值	1.0507	1.0460

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

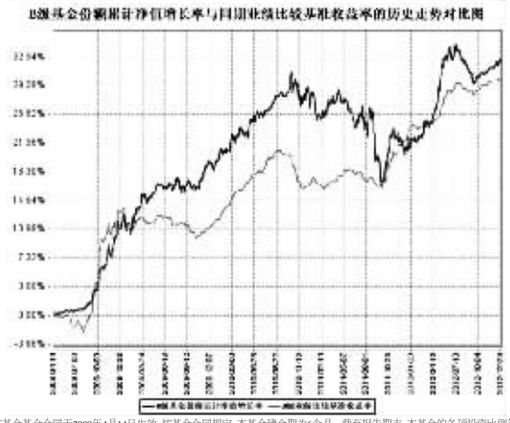
工银添利债券A

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	1.92%	0.09%	1.19%	0.03%	0.73%	0.06%

工银添利债券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	1.81%	0.08%	1.19%	0.03%	0.62%	0.05%

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



注:本基金基金合同于2008年4月14日生效,按基金合同规定,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:本基金投资于债券类资产(含可转换债券)的比例不低于基金资产的80%,本基金持有的公司债券、企业债券、金融债、短期融资券、资产支持证券等除国债、央行票据以外的固定收益类资产投资比例不低于债券类资产的90%,投资于股票等权益类证券的比例不超过基金资产的20%,且必须在权益类资产上市交易或流通受限解除后不超过3个月的时间内卖出,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%,投资于可转换债券的比例不超过基金资产净值的30%。

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		
江明波	固定收益投资总监,本基金的基金经理。	2008年4月14日	-	12	曾任鹏华基金普天债券基金经理、固定收益负责人;2004年6月至2006年12月,担任全国社保基金二零四组合和三零四组合基金经理;2006年加入工银瑞信,现任固定收益投资总监;2008年4月14日至今,担任工银添利基金基金经理;2011年2月10日至今,担任工银四季收益债券型基金基金经理。

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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

四季度宏观经济数据出现积极变化,PMI、发电量、工业增加值等明显回升,工业企业利润同比由负转正,显示经济见底复苏;通胀开始温和上升,但仍维持低位;央行通过公开市场操作持续投放流动性,7天正回购已逐渐成为全市场的名义锚,货币市场利率围绕7天正回购利率波动,流动性始终维持在中性水平。

四季度债券市场高等级债收益率小幅上行,中等信用债券收益率保持平稳,12月份股票市场大幅上升,受此带动,转债市场出现明显上涨。

本基金在四季度继续保持较高的中等等级的信用债配置,给组合带来较好正收益。同时维持了较高的转债配置,分享了12月份的市场上涨。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内,工银添利A净值增长率1.92%,工银添利B净值增长率1.81%,业绩比较基准收益率为1.19%。

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,经济将保持复苏进程,复苏的核心力量一方面来自于政府的基建投资,基建投资从2012年四季度开始已经加速,在三月份政府换届后,城镇化有望成为本届政府的工作重点,基建投资是实现城镇化必不可少的手段;另一方面的力量来自于房地产投资,2012年四季度开始房地产的销量持续增长,开发商拿地热情上升,拿地资金开始增加,2012年的房地产投资有望加速;目前的通胀仍维持低位,未来处于温和回升当中,由于通胀对于经济的弹性增加,需要警惕经济超预期强劲复苏所导致通胀的加速上升;中央经济工作会议提出"要适当扩大社会融资总规模,保持货币适度增加,保持人民币汇率基本稳定,切实降低实体经济发展的融资成本",因此货币总量会适度增长,而作为目前市场基准利率的公开市场操作7天正回购利率会保持平稳,整体流动性会在上半年维持在中性水平。

我们预期债券市场收益率会窄幅波动,市场大幅波动的可能性不大,但须警惕通胀加速上升所带来的市场风险,权益市场会有更多机会。市场的机会来自于转债和信用债,我们将继续维持信用债的高配置,并重点配置3年左右的债券,规避可能的高通胀风险;增加转债特别是股性转债的配置比例,并在适当时候做好止盈操作。

§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	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	6,269,852,021.46	90.44
	其中:债券	6,269,852,021.46	90.44
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	400,500,720.75	5.78
	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	114,865,949.80	1.66
6	其他资产	147,140,999.99	2.12
7	合计	6,932,359,692.00	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

本基金本报告期末未持有股票。

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

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	105,330,649.00	3.46
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,394,412,000.00	45.80
	其中:政策性金融债	1,394,412,000.00	45.80
4	企业债券	3,832,843,820.06	125.90
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	95,013,000.00	3.12
7	可转债	842,252,552.40	27.67
8	其他	-	-
9	合计	6,269,852,021.46	205.95

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	120222	12国开22	6,300,000	628,740,000.00	20.65
2	113001	中行转债	5,924,390	570,814,976.50	18.75
3	080216	08国开16	2,700,000	278,856,000.00	9.16
4	080214	08国开14	2,100,000	222,747,000.00	7.32
5	126018	08工铜债	2,249,380	194,661,345.20	6.39

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	256,766.41
2	应收证券清算款	29,640,536.92
3	应收股利	-
4	应收利息	116,824,315.12
5	应收申购款	419,381.54
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	147,140,999.99

5.8.4 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	113001	中行转债	570,814,976.50	18.75
2	110018	国电转债	148,639,744.00	4.88
3	110015	石化转债	43,354,953.90	1.42

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

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	工银添利债券A	工银添利债券B
本报告期期初基金份额总额	1,659,963,128.89	1,139,098,226.17
本报告期基金总申购份额	536,834,099.70	324,168,065.11
减:本报告期基金总赎回份额	384,188,653.19	373,468,616.43
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,812,608,575.40	1,089,797,674.85

§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信用添利债券型证券投资基金设立的文件;

2、《工银瑞信信用添利债券型证券投资基金基金合同》;

3、《工银瑞信信用添利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处。

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,可在合理时间内取得上述文件的复印件。

工银瑞信中小盘成长股票型证券投资基金

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:中国农业银行股份有限公司
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。

基金托管人中国农业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	工银瑞信中小盘股票
交易代码	481010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年2月10日
报告期末基金份额总额	736,933,129.05份
投资目标	通过投资高成长性的中小市值股票,追求基金资产长期稳定的增值和收益,在有效控制风险的前提下,力争持续实现超越业绩基准的超额收益。
投资策略	本基金运用国际化的视野审视中国经济和资本市场,依据定量和定性相结合的方法,考虑经济情景、类别资产收益风险预期等因素,在股票与债券等资产类别之间进行资产配置。 股票资产主要投资于中小盘股票,投资于具有高成长性、基本面良好的中小盘股票的资产占股票投资资产的比例不低于80%。本基金将首先采用定量分析指标,筛选出成长潜力较大的中小市值上市公司。基于对公司未来业绩发展的预测,采用股息贴现模型、自由现金流折现模型等方法评估公司股票的合理内在价值,同时结合股票的市场价格、考虑市盈率、市净率等相对估值指标,选择最具有投资吸引力的股票构建投资组合。
业绩比较基准	80%×中证700指数收益率+20%×上证国债指数收益率
风险收益特征	本基金是股票型基金,其预期收益及风险水平高于债券型基金与混合型基金,属于风险水平较高的基金。本基金主要投资于中小盘股票,在股票型基金中属于风险水平相对较高的投资产品。
基金管理人	工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

§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	-31,711,134.08
2.本期利润	17,843,675.55
3.加权平均基金份额本期利润	0.0240
4.期末基金资产净值	531,412,124.61
5.期末基金份额净值	0.721

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。

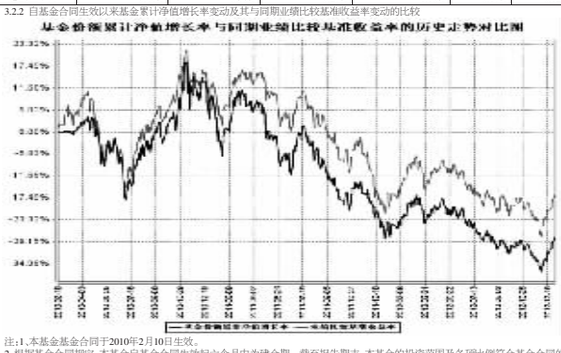
3.所列数据截止到2012年12月31日。

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	3.44%	0.98%	3.27%	1.10%	0.17%	-0.12%

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



注:1.本基金基金合同于2010年2月10日生效。

2.根据基金合同规定,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,本基金的投资范围及各项比例符合基金合同的规定:本基金股票资产占基金资产的比例为60%-95%,债券、现金等金融工具占基金资产的比例为5%-40%,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%。本基金的股票资产主要投资于中小盘股票,投资于具有高成长性、基本面良好的中小盘股票的资产占股票投资资产的比例不低于80%。

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		
王筱岑	本基金基金经理	2011年10月11日	-	15	曾任中国银行全球金融市场部首席交易员;2005年加入工银瑞信,曾任工银核心价值基金、工银精选平衡混合型基金、工银稳健成长股票型基金基金经理,专户投资部专户投资经理,2011年10月11日至今,担任工银中小盘基金基金经理;2012年12月5日至今,担任工银瑞信大盘蓝筹基金基金经理。
邵联峰	本基金基金经理	2012年7月4日	-	12	先后在海通证券历任高级研究员、投资经理,国都证券担任证券投资总部副总经理,中国再保险资产管理股份有限公司历任权益投资部助理总经理、研究发展部助理总经理,招商基金管理有限公司担任首席经济学家兼研究总监兼基金基金经理; 2010年加入工银瑞信,曾任专户投资总监,2012年4月26日至今担任工银基本面量化策略股票基金基金经理;2012年7月4日至今担任工银中小盘股票基金基金经理。
胡文彪	本基金基金经理	2012年11月20日	-	11	先后在国泰君安证券股份有限公司担任研究员,华林证券有限公司担任研究员。 2006年加入工银瑞信基金管理有限公司,历任产品开发部高级经理和权益投资部高级经理;2009年3月5日至2011年2月10日,担任工银沪深300基金基金经理;2009年8月26日至2011年2月10日,担任工银上证央企ETF基金基金经理;2010年2月10日至2011年3月16日,担任工银中小盘基金基金经理;2011年2月10日至今,担任工银双利债券基金基金经理;2011年3月16日至今,担任工银大盘蓝筹基金基金经理;2012年11月20日至今担任工银中小盘基金基金经理。

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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上证指数四季度迎来最近两年来少有的季度上涨,在跌破2000点之后,市场出现恐慌性下跌,并在12月份出现连续大幅上涨,本季度涨幅8.77%。银行、房地产、汽车、建筑、建材、家电等早周期行业涨幅较大,食品饮料、计算机、餐饮旅游、商贸零售、有色金属、纺织服装等防御性、年初以来相对抗跌的行业涨幅较小。A股出现极低的估值状态,在预期经济、政策风险释放后,出现快速的估值修复,并将继续演化。因此,本基金在本季度进行了组合调整,大幅减少食品饮料行业配置,适当减持了医药行业配置,并增加了房地产、基础化工、煤炭、有色等周期行业的配置。季度末,在预期经济处于弱复苏下,适当超配早周期类行业,其余行业配置较为均衡。

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3.44%,业绩比较基准收益率为3.27%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为,本轮国内经济回升是在去库存接近尾声、政策驱动下由基建和地产带动的复苏,预计目前经济上行至少会持续到明年一季度。综合考虑财政政策仍趋向宽松和总体政策基调连续性,目前流动性大幅下行风险不大。基建和地产投资目前仍是带动经济回升的主要驱动因素,且两者在未来一段时间仍将持续。2013年通货膨胀较2012年有所上升,但全年压力不大;工业品出厂价格也将回升,有利于制造业经营形势的改善。美国经济将持续复苏,并可能带动国内出口的增长;欧洲经济仍然处于衰退之中,还没有明显走出的迹象。

A股市场在2013年有望继续反弹,但短期存在震荡的可能,年底在大盘股票大幅上涨后,行业面临分化。从投资时钟角度看,目前经济处于复苏趋势的可能性大,因此股票资产配置上需要相对积极。行业配置上,近期重点配置早周期行业,包括银行、地产、乘用车、建筑、建材、工业金属、家电等。主题投资方面,经济关注新一轮经济周期下的新型工业化、信息化、城镇化、农业现代化(新四化)下的投资机会,涉及高铁板块、医疗保健、智慧城市、移动互联网等。

§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	439,771,512.24	81.00
	其中:股票	439,771,512.24	81.00
2	固定收益投资	44,479,000.00	8.19
	其中:债券	44,479,000.00	8.19
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	41,000,000.00	7.55
	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	4,974,878.84	0.92
6	其他资产	12,675,878.22	2.33
7	合计	542,901,269.30	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

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	4,710,400.00	0.89
B	采掘业	40,783,054.10	7.67
C	制造业	200,795,023.10	37.79
C0	食品、饮料	48,593,198.14	9.14
C1	纺织、服装、皮毛	21,088,000.80	3.97
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	26,664,211.55	5.02
C5	电子	10,677,103.90	2.01
C6	金属、非金属	30,145,189.46	5.67
C7	机械、设备、仪表	41,099,781.80	7.73
C8	医药、生物制品	22,527,537.45	4.24
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	4,743,000.00	0.89
E	建筑业	4,293,968.84	0.81
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	26,852,735.40	5.05
H	批发和零售贸易	27,462,030.78	5.17
I	金融、保险业	59,864,797.36	11.27
J	房地产业	43,288,880.40	8.15
K	社会服务业	23,788,814.26	4.48
L	传播与文化产业	3,188,808.00	0.60
M	综合类	-	-
	合计	439,771,512.24	82.76

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。

5.3 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

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	002311	海大集团	1,132,874	19,372,145.40	3.65
2	600066	宇通客车	600,811	15,140,437.20	2.85
3	601009	南京银行	1,337,390	12,303,988.00	2.32
4	000002	万 科A	959,993	10,195,125.66	1.92
5	002142	宁波银行	938,043	9,999,538.38	1.88
6	002155	辰州矿业	489,861	9,836,408.88	1.85
7	000402	金 融 街	1,399,985	9,449,898.75	1.78
8	600887	伊利股份	422,525	9,287,099.50	1.75
9	000783	长江证券	960,000	9,024,000.00	1.70
10	601318	中国平安	195,000	8,831,550.00	1.66

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	30,012,000.00	5.65
	其中:政策性金融债	30,012,000.00	5.65
4	企业债券	9,649,500.00	1.82
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	4,817,500.00	0.91
8	其他	-	-
9	合计	44,479,000.00	8.37

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	120305	12进出05	300,000	30,012,000.00	5.65
2	126008	08上汽债	50,000	4,849,500.00	0.91
3	113001	中行转债	50,000	4,817,500.00	0.91
4	126011	08石化债	50,000	4,800,000.00	0.90

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	1,082,743.11
2	应收证券清算款	10,815,429.51
3	应收股利	-
4	应收利息	771,781.16
5	应收申购款	5,924.44
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,675,878.22

5.8.4 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	113001	中行转债	4,817,500.00	0.91

5.8.5 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	000002	万科A	10,195,125.66	1.92	重大事项

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

本报告期期初基金份额总额	749,304,222.39
本报告期基金总申购份额	5,411,192.81
减:本报告期基金总赎回份额	17,782,286.15
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	736,933,129.05

§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.中国证监会核准工银瑞信中小盘成长股票型证券投资基金募集的文件;

2、《工银瑞信中小盘成长股票型证券投资基金基金合同》;

3、《工银瑞信中小盘成长股票型证券投资基金托管协议》;

4.基金管理人业务资格批件、营业执照;

5.基金托管人业务资格批件、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。

工银瑞信全球精选股票型证券投资基金

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16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	工银全球精选股票(QDII)
交易代码	486002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年5月25日
报告期末基金份额总额	110,052,255.24份
投资目标	全球范围内具有竞争优势且成长性良好的上市公司。
投资策略	通过在全球范围内采用"自上而下"方法进行国家及地区的资产配置,综合运用定性和定量分析方法精选全球股票,并且在全球范围内进行投资组合风险收益优化,追求基金资产的长期稳健增值。
业绩比较基准	MSCI世界指数总收益
风险收益特征	本基金是投资于全球资本市场的股票型基金,属于风险水平较高的基金品种,其预期收益及风险水平高于债券型基金,亦高于混合型基金。
基金管理人	工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

2.2 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	Wellington Management Company, LLP	The Bank of New York Mellon Corporation
	中文	威灵顿管理有限责任合伙制公司	纽约梅隆银行股份有限公司
注册地址		280 Congress Street, Boston, MA, USA	One Wall Street, New York
办公地址		280 Congress Street, Boston, MA, USA	One Wall Street, New York
邮政编码		2210	NY 10286

§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	433,086.94
2.本期利润	867,254.11
3.加权平均基金份额本期利润	0.0077
4.期末基金资产净值	104,164,325.90
5.期末基金份额净值	0.946

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