工银瑞信主题策略股票型证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013年9月30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:二〇一三年十月二十四日

§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10月21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2013年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	工银主题策略股票
交易代码	481015
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年10月24日
报告期末基金份额总额	83,921,449.37份
投资目标	结合宏观经济转型方向,通过分析社会经济热点动向,把握相关主题投资机会,追求基金资产长期稳定的增值和收益,在控制投资风险的同时,力争持续实现超越业绩基准的收益。
投资策略	类别资产配置上,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,考虑经济增望、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。在股票投资方面,本基金主要采取主题投资策略,在宏观经济发展的不同阶段,关注经济发展热点,深入挖掘潜在的主题投资机会,寻找实质受益的上市公司,并综合考虑其基本面情况,选择具备投资价值的股票,构建投资组合,并不断优化组合,争取获得超越业绩基准的收益水平。本基金还将在法规允许的范围内,基于谨慎原则利用权证以及其它金融工具进行套利交易或风险管理,为基金收益提供增加价值。
业绩比较基准	80%×沪深300指数收益率 + 20%×中债综合指数收益率
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、混合型基金和货币市场基金,属于风险水平较高的基金。
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(2013年7月1日 - 2013年9月30日)
1.本期已实现收益	10,302,412.58
2.本期利润	20,897,152.06
3.加权平均基金份额本期利润	0.2213
4.期末基金资产净值	109,527,128.96
5.期末基金份额净值	1.305

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2013年09月30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	19.72%	1.66%	7.40%	1.15%	12.32%	0.51%

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2011年10月24日生效。

2、按基金合同规定,本基金建仓期为6个月,截至报告期末,本基金的投资符合基金合同的相关规定;本基金股票资产占基金资产的比例为60%-95%,债券、现金等金融工具及其他资产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%。

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		
黄安乐	本基金的基金经理	2011年11月23日	-	10	先后在天相投资顾问有限公司担任研究员、国信证券经济研究所担任资深分析师、国信证券资产管理总部担任投资经理、研究员;2010年加入工银瑞信,曾任高级研究员兼专户投资顾问,2011年11月23日至今担任工银主题策略股票基金基金经理,2013年9月23日至今担任工银瑞信精选平衡基金基金经理。
曹廷业	权益投资部总监,本基金的基金经理。	2011年10月24日	-	12	CFA、FRM:先后在东方汇理担任结构基金和证券基金经理,香港恒生投资管理公司担任香港中国股票和QFII基金投资经理;2007年加入工银瑞信,现任权益投资部总监;2007年11月29日至2009年5月17日,担任工银核心价值基金基金经理;2008年2月14日至2009年12月25日,担任工银全球基金基金经理;2009年5月18日至今,担任工银成长基金基金经理;2011年10月24日至今,担任工银主题策略股票基金基金经理;2013年9月23日至今担任工银瑞信中国机会全球配置基金基金经理。

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不超过该证券当日成交量的5%。

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

2013年3季度,除了8月份出现过短暂的风格转换迹象(即既估值大盘蓝筹板块表现较好)之外,其余的时间仍然是各种成长股以及概念板块的天下。TMT板块继续表现突出,尤其是传媒和计算机;而同时,上海自贸区、土地流转改革、传统商业网络化等概念也带动了相应板块的大幅度上涨,市场热点纷呈。

目前的市场特征,更多地表现为概念的炒作以及对估值的拔高,股价上涨的背后短期内缺乏真实业绩增长的支撑,我们对这种现象保持警惕;另一方面,如之前我们一直认为的,中国传统的经济增长模式面临瓶颈,与投资相关的行业需要谨慎对待,更多的目光应该投向新兴经济和转型经济。综合下来,新兴的板块很贵,传统的领域缺乏机会,因此,本基金在3季度的投资操作最为重视的还是特定板块上个股选择,我们在节能环保、通信、光伏、传媒、计算机、医药等领域精选个股进行重仓配置,取得了较好的投资回报。

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19.72%,业绩比较基准收益率为7.40%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

三季度国内宏观经济的回升力度不大且有可能就此结束,4季度的经济回落值得担忧,而从企业盈利的角度分析,如果去掉银行的影响,多数行业的中报业绩是下降的;而流动性、通胀等因素短期内对股市可能是中性的。如此看来,宏观经济对股市的影响,我们认为中性偏悲观。

不过,我们认为市场仍存在结构性的投资机会,尤其是一些确定性较高的行业和板块,如4G、高铁投资、有品牌的大众消费品、TMT产业中部分细分行业、政策持续支持的节能环保等。同时,我们也认为,需要警惕高估值的风险,对缺乏真实业绩支撑的概念炒作要谨慎对待。

§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	98,698,939.64	88.56
	其中:股票	98,698,939.64	88.56
2	固定收益投资	9,975,000.00	8.95
	其中:债券	9,975,000.00	8.95
	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	1,280,295.54	1.15
6	其他资产	1,490,320.16	1.34
7	合计	111,444,555.34	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

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	4,258,600.00	3.89
B	采矿业	-	-
C	制造业	75,558,668.94	68.99
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	905,600.00	0.83
F	批发和零售业	7,158,926.70	6.54
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,467,144.00	8.64
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,350,000.00	1.23
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	98,698,939.64	90.11

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	600887	伊利股份	218,819	9,776,832.92	8.93
2	000063	中兴通讯	568,000	9,428,800.00	8.61
3	300257	开山股份	228,000	8,105,400.00	7.40
4	600835	上海机电	438,000	6,942,300.00	6.34
5	601012	隆基股份	390,000	6,563,700.00	5.99
6	002080	中材科技	428,000	6,278,760.00	5.73
7	300113	顺网科技	83,800	5,912,090.00	5.40
8	002475	立讯精密	158,000	4,484,040.00	4.09
9	601607	上海医药	244,000	3,799,080.00	3.47
10	600690	青岛海尔	222,400	2,962,368.00	2.70

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	9,975,000.00	9.11
	其中:政策性金融债	9,975,000.00	9.11
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	9,975,000.00	9.11

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	130201	13国开01	100,000	9,975,000.00	9.11

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末股指期货。

5.8.2 本基金投资股指期货的投资政策

本报告期内,本基金未运用股指期货进行投资。

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

本基金本报告期末投资国债期货。

5.9.3 本期国债期货投资评价

无。

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 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	98,764.42
2	应收证券清算款	1,050,402.36
3	应收股利	-
4	应收利息	240,659.40
5	应收申购款	100,493.98
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,490,320.16

5.10.4 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。

5.10.5 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	600690	青岛海尔	2,962,368.00	2.70	重大事项

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

报告期期初基金份额总额	106,617,175.93
报告期期间基金总申购份额	10,651,847.68
减:报告期期间基金总赎回份额	33,347,574.24
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	83,921,449.37

§7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

本基金的管理人在本报告期内运用固有资金投资本基金情况未有变化。

§8 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主题策略股票型证券投资基金设立的文件;

2、《工银瑞信主题策略股票型证券投资基金合同》;

3、《工银瑞信主题策略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。

9.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的办公场所。

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。

工银瑞信消费服务行业股票型证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013年9月30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:二〇一三年十月二十四日

§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10月21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2013年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	工银消费服务股票
交易代码	481013
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年4月21日
报告期末基金份额总额	1,175,438,664.16份
投资目标	通过投资消费服务类行业股票,追求基金资产长期稳定增值,在合理风险限度内,力争持续实现超越业绩基准的超额收益。
投资策略	本基金建立系统化、纪律化的投资流程,遵循初选投资对象、公司治理评估、行业地位与竞争优势评估、公司财务分析、投资吸引力评估、组合构建及优化等过程,选择具有投资价值的股票,构造投资组合。
业绩比较基准	80%×沪深300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。本基金主要投资于消费服务行业股票,在股票型基金中属于中等偏高风险水平的投资产品。
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(2013年7月1日 - 2013年9月30日)
1.本期已实现收益	42,445,517.20
2.本期利润	106,623,663.14
3.加权平均基金份额本期利润	0.0819
4.期末基金资产净值	1,142,623,282.30
5.期末基金份额净值	0.972

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2013年9月30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	9.21%	1.12%	7.70%	1.15%	1.51%	-0.03%

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2011年4月21日生效。

2、根据基金合同规定,本基金建仓期为6个月。本报告期,本基金投资组合比例符合基金合同关于投资比例的各项约定。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%。其中,基金持有的消费服务行业股票占基金股票资产的比例不低于80%,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		
何江旭	权益投资总监,本基金的基金经理。	2011年4月21日	-	16	曾担任国泰基金金鑫、基金金鼎、金马稳健回报、金鹰增长以及金牛创新成长基金的基金经理,基金管理部总监兼权益投资副总监;2009年加入工银瑞信,现任权益投资总监;2010年4月12日至今,担任工银核心价值基金基金经理;2011年4月21日至今,担任工银消费服务行业基金的基金经理。
王勇	本基金的基金经理	2011年11月7日	-	6	先后在慧眼国际咨询有限公司担任销售主管,香港新世界数字多媒体公司担任市场经理;2007年加入工银瑞信,曾任研究员兼专户投资顾问,2011年11月7日至今担任工银消费服务行业基金的基金经理,2011年12月27日至今担任工银保本混合基金基金经理,2013年2月7日至今担任工银瑞信保本2号混合型基金基金经理,2013年6月26日起至今担任工银瑞信保本3号混合型基金基金经理。

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不超过该证券当日成交量的5%。

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

2013年三季度市场走势整体向上,沪深300、中证700等指数都显著上涨,创业板更是上涨超过35%。结构方面,市场延续二季度的分化走势,股价的主要驱动因素是预期带动的估值提升而不是业绩增长,预期向好的TMT、大众消费等行业上涨幅度巨大,而以银行、地产等行业为代表的传统经济虽然盈利基本面良好,但是估值下滑明显,市场对于传统周期行业预期非常悲观。

本基金二季度操作稳健,对于高估值的新兴行业参与相对谨慎,重点配置了业绩增速合理、估值安全边际高的大众消费、家电、医药等行业,同时降低了前期涨幅较大的传媒等TMT行业的配置比例。组合总体表现稳健有余弹性不足,在市场快速上涨阶段表现不尽如人意,但是组合重点持仓公司总体业绩增长符合预期,防御性显著增强。

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9.21%,业绩比较基准收益率为7.7%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观经济展望:当前宏观经济最大的问题是总需求不足,主要原因是部分投资性行业发展严重过剩、产能利用率低且重复建设明显,然而另一方面人工和土地价格却刚性提升,资金成本也在高位徘徊,最终结果是传统周期性行业经营压力巨大。由于我国目前仍处于投资主导的经济增长阶段,上述问题将造成相当长的时间内市场总体盈利能力不容乐观,特别是收入增速方面。但是,部分受益于经济转型的大众消费和必需投资行业有望超预期,值得重点关注。

市场走势展望:三季度市场走势的最主要驱动因素还是转型预期下的资金偏好,大多数行业表现良好的原因都是估值提升,而被盈利推动上涨的行业见毛麟角。本基金管理人认为未来市场对于盈利的关注度大概率会逐步提升,虽然短期来看市场在原有资金和预期驱动的惯性舒适轨道上继续留恋的动力还相当强。展望下个季度,本组合操作将以配置盈利超预期、估值相对合理的行业和优质成长股为主,力求通过盈利增长和年底的估值切换为投资者实现良好的收益。

§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	权益投资	1,023,837,158.55	88.61
	其中:股票	1,023,837,158.55	88.61
2	固定收益投资	69,825,000.00	6.04
	其中:债券	69,825,000.00	6.04
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	29,760,134.88	2.58
	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	18,473,360.83	1.60
6	其他资产	13,599,006.25	1.18
7	合计	1,155,494,660.51	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

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	667,773,166.29	58.44
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	130,350,670.94	11.41
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	33,937,926.78	2.97
J	金融业	135,432,538.30	11.85
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	11,260,856.24	0.99
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	36,088,000.00	3.16
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	8,994,000.00	0.79
S	综合	-	-
	合计	1,023,837,158.55	89.60

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	600887	伊利股份	1,900,000	84,892,000.00	7.43
2	002311	海大集团	5,999,944	74,999,300.00	6.56
3	601933	永辉超市	4,273,700	60,173,696.00	5.27
4	000651	格力电器	2,000,000	53,120,000.00	4.65
5	000063	中兴通讯	2,999,873	49,797,891.80	4.36
6	000895	双汇发展	1,000,000	46,450,000.00	4.07
7	600690	青岛海尔	3,000,000	39,960,000.00	3.50
8	601318	中国平安	1,099,819	39,263,538.30	3.44
9	000538	云南白药	319,982	37,457,092.92	3.28
10	601607	上海医药	2,399,812	37,365,072.84	3.27

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	69,825,000.00	6.11
	其中:政策性金融债	69,825,000.00	6.11
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	69,825,000.00	6.11

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	130201	13国开01	700,000	69,825,000.00	6.11

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

基金本报告期末股指期货。

5.8.2 本基金投资股指期货的投资政策

本报告期内,本基金未运用股指期货进行投资。

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

本报告期内,本基金未运用国债期货进行投资

5.9.3 本期国债期货投资评价

无。

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 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	412,481.74
2	应收证券清算款	11,451,599.45
3	应收股利	-
4	应收利息	1,692,660.57
5	应收申购款	42,264.49
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,599,006.25

5.10.4 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可转换债券。

5.10.5 报告期末前十名股票中在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	600690	青岛海尔	39,960,000.00	3.50	重大事项

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

报告期期初基金份额总额	1,386,263,660.61
报告期期间基金总申购份额	3,908,123.34
减:报告期期间基金总赎回份额	214,733,119.79
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	1,175,438,664.16

§7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

本基金管理人在本报告期内运用固有资金投资本基金情况未有变化。

§8 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消费服务股票型证券投资基金设立的文件;

2、《工银瑞信消费服务股票型证券投资基金基金合同》;

3、《工银瑞信消费服务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。

9.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的办公场所。

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。

工银瑞信货币市场基金

2013 第三季度 报告

2013年9月30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:二〇一三年十月二十四日

§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10月21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2013年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	工银货币
交易代码	482002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年3月20日
报告期末基金份额总额	23,431,654,625.08份
投资目标	力求保证基金资产安全和良好流动性的前提下,获得超过业绩比较基准的收益。
投资策略	在确定的利率策略和期限结构、类属配置策略下,通过短期货币市场工具的投资来获取稳定的收益。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为税后6个月银行定期储蓄存款利率,即6~利息税率)×6个月银行定期储蓄存款利率
风险收益特征	本基金为货币市场基金,在所有证券投资基金中,是风险相对较低的基金产品。在一般情况下,其风险与预期收益均低于一般债券基金,也低于混合型基金与股票型基金
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

§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(2013年7月1日 - 2013年9月30日)
1. 本期已实现收益	289,559,544.70
2.本期利润	289,559,544.70
3.期末基金资产净值	23,431,654,625.08

注:(1)本基金收益分配是按日结转份额。

(2)所列数据截止到2013年09月30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。

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

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	1.2095%	0.0009%	0.7058%	0.0000%	0.5037%	0