工银瑞信睿智深证100指数分级证券投资基金

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:中国民生银行股份有限公司
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。

基金托管人中国民生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	工银深证100指数分级 (场内简称:工银100A、工银100B)		
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	39,545,628.13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	10,592,768.00份	10,592,769.00份	18,360,091.13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 (2013年7月1日 - 2013年9月30日)
1.本期已实现收益	-163,172.06
2.本期利润	4,284,139.34
3.加权平均基金份额本期利润	0.0926
4.期末基金资产净值	39,925,543.98
5.期末基金份额净值	1.0096

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)本基金已于2013年07月01日进行了基金份额折算。

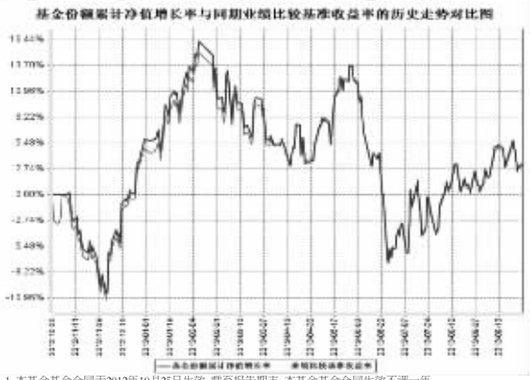
(4)所列数据截止到2013年9月30日。

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	9.59%	1.39%	9.19%	1.37%	0.40%	0.02%

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。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、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
何江	指数投资部副总监、本基金的基金经理。	2012年10月25日	-	8	先后在北京方速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2013年7月22日担任工银上证央企ETF基金基金经理;2011年5月25日至今担任工银沪深300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未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的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本报告期内,本基金跟踪标的指数的日均偏离度为0.03%,偏离度年化标准差为0.92%。本基金跟踪误差产生的主要来源是:1)申购赎回的影响;2)成份股票的停牌;3)指数中成份股票的调整等。

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9.59%,业绩比较基准收益率为9.19%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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	37,832,095.31	93.36
	其中:股票	37,832,095.31	93.36
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	2,640,147.64	6.51
6	其他资产	51,995.38	0.13
7	合计	40,524,238.33	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	209,600.19	0.52
B	采矿业	1,411,637.31	3.54
C	制造业	22,453,825.67	56.24
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	222,512.40	0.56
E	建筑业	565,765.09	1.42
F	批发和零售业	1,550,917.90	3.88
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	1,090,779.50	2.73
J	金融业	4,139,638.69	10.37
K	房地产业	3,887,089.21	9.74
L	租赁和商务服务业	191,360.00	0.48
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,416,109.85	3.55
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	370,830.00	0.93
S	综合	322,029.50	0.81
	合计	37,832,095.31	94.76

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。

5.2.2 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	249,145	2,274,693.85	5.70
2	000651	格力电器	65,046	1,727,621.76	4.33
3	002024	苏宁云商	120,694	1,550,917.90	3.88
4	000001	平安银行	121,057	1,438,157.16	3.60
5	000776	广发证券	84,803	1,004,915.55	2.52
6	000538	云南白药	7,950	930,627.00	2.33
7	000858	五 粮 液	51,668	930,024.00	2.33
8	000063	中兴通讯	53,936	895,337.60	2.24
9	000333	美的集团	20,682	894,289.68	2.24
10	002241	歌尔声学	20,141	851,561.48	2.13

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 报告期末本基金投资的股指期货投资情况说明

5.8.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.8.2 本基金投资股指期货的投资政策

本报告期内,本基金投资于股指期货是为了降低跟踪误差,进行有效的现金管理。

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

本基金本报告期末未持有国债期货投资,也无期间损益。

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

2013年2月22日,五粮液公司之控股子公司“宜宾五粮液酒类销售有限责任公司”(以下简称“酒类销售公司”)收到四川省发展和改革委员会(以下简称“四川发改委”)《行政处罚决定书》川发改价检处[2013]1号。该文件内容主要包括:2012年12月,酒类销售公司通过合同约定、价格管控、考核奖惩等方式,对经销商向第二人销售五粮液白酒的最低价格进行限定,对市场竞争秩序产生了不利影响,对消费者的合法权益造成了损害,违反了《中华人民共和国反垄断法》第十四条的规定。

本产品为被动投资产品,与深证100挂钩,故持有五粮液(000858)。

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	48,575.99
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	837.02
5	应收申购款	2,582.37
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	51,995.38

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

5.10.5.1 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

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.10.5.2 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。

5.10.6 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

项目	工银100A	工银100B	工银100
报告期期初基金份额总额	11,007,007.00	11,007,008.00	44,143,226.38
报告期期间基金总申购份额	-	-	2,312,367.60
减:报告期期间基金总赎回份额	-	-	28,923,980.85
报告期期间基金拆分变动份额	-414,239.00	-414,239.00	828,478.00
报告期期末基金份额总额	10,592,768.00	10,592,769.00	18,360,091.13

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 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。

9.2 存放地点

基金管理人或基金托管人住所。

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。

工银瑞信大盘蓝筹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	工银大盘蓝筹股票
交易代码	481008
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年8月4日
报告期末基金份额总额	493,771,841.37份
投资目标	通过投资大盘蓝筹型股票,追求基金资产长期稳定的增值和收益,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	本基金的股票资产主要投资于大盘蓝筹型股票,投资于大盘蓝筹股票的资产占股票投资资产的比例不低于80%。蓝筹股票是指那些经营稳健、财务状况良好、公司在所属行业处于领导地位的公司股票。蓝筹股票一般具有较好的分红记录,在投资者心中形象良好。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大盘蓝筹股票,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	预期收益及风险水平高于债券型基金与混合型基金,在股票型基金中属于中等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	7,627,828.86
2.本期利润	25,604,913.21
3.加权平均基金份额本期利润	0.0504
4.期末基金资产净值	383,880,819.54
5.期末基金份额净值	0.777

注:(1)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。

(2)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。

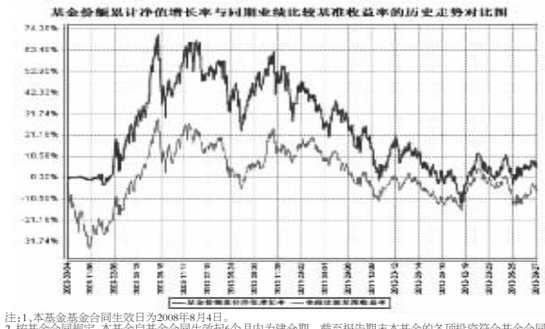
(3)所列数据截止到2013年9月30日。

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	6.73%	1.13%	7.70%	1.15%	-0.97%	-0.02%

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.本基金基金合同生效日为2008年8月4日。

2.按基金合同规定,本基金自基金合同生效起6个月内为建仓期。截至报告期末本基金的各项投资符合基金合同关于投资范围、投资禁止行为与限制的规定;股票资产占基金资产净值的比例为60%-95%,债券及现金资产占基金资产净值的比例为5%-40%。

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		
胡文彪	本基金的基金经理	2011年3月16日	-	12	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2013年1月18日,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。
王筱岑	本基金的基金经理	2012年12月5日	-	16	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,担任工银大盘蓝筹基金基金经理。

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未超过该证券当日成交量的5%。

4.4 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金净值增长率为6.73%,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

今年以来的行情分化极大,新兴产业和代表未来成长方向的行业受到追捧,而传统行业被抛弃,沪深300指数代表的大盘蓝筹股表现较差。我们虽然战胜了指数,但由于过于注重股票的风险收益性价比,在一个重势不重质的市场里,未能取得令人满意的投资回报。展望4季度,宏观经济数据在3季度出现了回升,我们判断是一个库存周期调整的结果,这一过程已经接近尾声。3季报的陆续公布,以及部分公司对全年盈利的展望,将对市场造成一定的影响。三中全会即将在11月召开,会议将指出未来中国的发展和改革方向,我们将密切关注可能的投资机会。

§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	323,374,073.45	83.40
	其中:股票	323,374,073.45	83.40
2	固定收益投资	59,840,102.30	15.43
	其中:债券	59,840,102.30	15.43
	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	1,585,958.97	0.41
6	其他资产	2,952,948.46	0.76
7	合计	387,753,083.18	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	6,277,005.00	1.64
B	采矿业	8,983,993.40	2.34
C	制造业	200,856,403.53	52.32
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,993,819.84	1.30
E	建筑业	7,430,605.68	1.94
F	批发和零售业	5,976,048.63	1.56
G	交通运输、仓储和邮政业	5,154,080.00	1.34
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	49,338,532.62	12.85
K	房地产业	28,865,484.75	7.52
L	租赁和商务服务业	1,243,200.00	0.32
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	4,254,900.00	1.11
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	323,374,073.45	84.24

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	000333	美的集团	410,193	17,736,745.32	4.62
2	000063	中兴通讯	1,050,000	17,430,000.00	4.54
3	600016	民生银行	1,700,000	16,252,000.00	4.23
4	600887	伊利股份	300,000	13,404,000.00	3.49
5	601299	中国北车	2,879,918	11,980,458.88	3.12
6	601166	兴业银行	775,000	8,656,750.00	2.26
7	600036	招商银行	739,620	8,076,650.40	2.10
8	600519	贵州茅台	55,000	7,476,700.00	1.95
9	000895	双汇发展	160,000	7,432,000.00	1.94
10	600583	海油工程	1,000,000	7,400,000.00	1.93

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	19,866,000.00	5.18
	其中:政策性金融债	19,866,000.00	5.18
4	企业债券	39,974,102.30	10.41
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	59,840,102.30	15.59

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	130218	13国开18	200,000	19,866,000.00	5.18
2	122065	11上港01	93,000	9,298,140.00	2.42
3	126019	09长虹债	100,000	9,195,000.00	2.40
4	126016	08宝钢债	68,330	6,635,526.30	1.73
5	126011	08石化债	54,880	5,402,936.00	1.41

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

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.8.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金没有投资股指期货。

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	140,305.48
2	应收证券清算款	2,247,907.47
3	应收股利	-
4	应收利息	544,884.61
5	应收申购款	19,850.90
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,952,948.46

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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	516,690,441.58
报告期期间基金总申购份额	5,846,150.48
减:报告期期间基金总赎回份额	28,764,750.69
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	493,771,841.37

§7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

本基金管理人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大盘蓝筹股票型证券投资基金设立的文件;

2.《工银瑞信大盘蓝筹股票型证券投资基金基金合同》;

3.《工银瑞信大盘蓝筹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住所。

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,可在合理时间内取得上述文件的复印件。

工银瑞信中国机会全球配置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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年10月22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

2.1 基金基本情况

基金简称	工银全球股票 (QDII)
交易代码	486001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年2月14日
报告期末基金份额总额	815,540,790.49份
投资目标	全球范围内受益于中国经济持续增长的公司。
投资策略	通过在全球范围内分散投资,围绕着控制投资组合风险,追求基金长期资产增值并战胜业绩基准。
业绩比较基准	40%×MSCI中国指数收益率+60%×MSCI全球股票指数收益率
风险收益特征	本基金属于全球股票型基金,在一般情况下,其风险与预期收益高于债券型基金,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	Citibank N.A.
	中文	威灵顿管理有限责任合伙制公司	美国花旗银行有限公司
注册地址		280 Congress Street, Boston, MA, USA	3900 Paradise Road, Suite 127, Las Vegas, Nevada 89109, USA
办公地址		280 Congress Street, Boston, MA, USA	399 Park Avenue, New York, NY10022, USA
邮政编码		2210	10022

§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	24,170,775.93
2.本期利润	68,197,866.71
3.加权平均基金份额本期利润	0.0787
4.期末基金资产净值	844,475,063.21
5.期末基金份额净值	1.035

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	7.83%	0.71%	9.24%	0.64%	-1.41%	0.07%

注:同期业绩比较基准以人民币计价,已包含人民币汇率波动等因素产生的效应。

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.本基金合同于2008年2月14日生效。

2.按照本基金基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起6个月内为建仓期,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中的规定;本基金投资中国公司组合