

## 工银瑞信双债增强债券型证券投资基金

### 2013 第四季度 报告

2013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:中国工商银行股份有限公司**  
**报告送出日期:二〇一四年一月二十二日****§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。

基金管理人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2014年1月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合情况等,复核内容与前述内容无实质性差异,该导致数据或重大差错。

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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失,投资者自行承担投资风险,投资者在作出投资决策前请仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中所列数据未经审计,本报告中所列数据截至2013年12月31日止。

**§2 基金产品概况**

基金名称	工银瑞信双债增强债券型证券投资基金(工银双债)
交易代码	164814
基金运作方式	上市型开放式基金(LOF)
基金合同生效日	2013年9月25日
报告期内基金份额总额	412,116,928.75份
投资目标	在固定收益资产投资的基础上,通过积极主动的转债、信用债投资管理,追求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金在资产配置策略的基础上,通过积极配置可转债以获取相对稳定的收益,同时,通过重点投资可转债信用债以及灵活配置股票资产的投资机会来追求基金资产的长期增值。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为:天相可转债指数收益率*60%+中债企业债总指数收益率*40%
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,高于货币型基金,属于证券投资基金中较低风险和较低预期收益的品种。本基金的投资比例不低于固定收益类资产的90%,其中信用债资产的投资比例不低于固定收益类资产的70%,其中可转债资产的投资比例不低于固定收益类资产的30%。本基金的风险收益特征与沪深300指数存在差异,本基金的风险收益特征与沪深300指数存在差异,本基金的风险收益特征与沪深300指数存在差异。
基金管理人	工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

**§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	
1.本期已实现收益	4,170,179.53
2.本期利润	1,957,431.92
3.加权平均基金份额本期利润	0.0047
4.期末基金份额净值	414,301,900.39
5.期末基金净值增长率	1.05%

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)本期利润=本期实现收益-本期公允价值变动收益-其他收入(不含公允价值变动收益)-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)本期利润截至到2013年12月31日。

(4)本基金基金合同生效日为2013年9月25日。

3.2 本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	
截至2013年12月31日,本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2013年9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.按基金合同约定,本基金合同为6个月建仓期,本基金的各项投资比例应符合关于投资范围及投资限制的规定,债券等固定收益类资产占基金资产净值比例不低于80%,其中,可转债(含分离交易的可转换债券)和信用债合计投资比例不低于固定收益类资产的60%,其中信用债是公司债、企业债、短期融资券、商业银行金融债、次级债、资产支持证券、中期票据等在企业机构发行的非国家信用债,可转债(含分离交易的可转换债券)的投资比例不低于固定收益类资产的30%;股票、权证等权益类资产占基金资产净值的比例不超过20%。	

3.3 本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	
截至2013年12月31日,本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2013年9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.按基金合同约定,本基金合同为6个月建仓期,本基金的各项投资比例应符合关于投资范围及投资限制的规定,债券等固定收益类资产占基金资产净值比例不低于80%,其中,可转债(含分离交易的可转换债券)和信用债合计投资比例不低于固定收益类资产的60%,其中信用债是公司债、企业债、短期融资券、商业银行金融债、次级债、资产支持证券、中期票据等在企业机构发行的非国家信用债,可转债(含分离交易的可转换债券)的投资比例不低于固定收益类资产的30%;股票、权证等权益类资产占基金资产净值的比例不超过20%。	

**§4 基金经理(或基金经理小组)简介**

姓名	王佳	任本基金的基金经理期间	2013年9月25日	证券从业年限	8	说明	注册会计师,先后任职于毕马威会计师事务所、德勤会计师事务所,担任中国中冶财务经理,2007年11月至2012年1月担任工银瑞信2007年11月至2012年1月担任工银瑞信基金,担任固定收益研究员,2013年1月担任工银瑞信基金固定收益基金经理,2013年9月25日至今担任工银双债增强债券型基金经理。
----	----	-------------	------------	--------	---	----	--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

**§5 投资组合报告**

5.1 报告期末基金资产组合情况	
5.1.1 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。	
5.1.2 本基金投资的前十名股票中,没有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。	
5.1.3 其他资产	
5.2 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细	
5.3 报告期末持有的股票明细	
5.4 报告期末持有的权证明细	
5.5 报告期末持有的股指期货合约	
5.6 报告期末持有的国债期货合约	
5.7 报告期末持有的资产支持证券明细	
5.8 报告期末持有的贵金属投资明细	
5.9 报告期末持有的其他资产	

**§6 开放式基金份额变动**

项目	工银双债增强A	工银双债增强B
基金合同生效以来(2013年10月31日)基金份额总额	398,620,000.47	362,118,164.39
报告期期初基金份额总额	520,000.57	523,899.82
报告期基金申购份额	16,496	16,800,006.92
报告期基金赎回份额(份额减少以“-”填列)	129,340	12,584,608.08
报告期期末基金份额总额	399,144,081.01	362,641,474.21

**§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况**

基金管理人本报告期未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**

1. 基金管理人于2013年10月31日在指定媒体及公司网站上披露了《工银瑞信基金管理有限公司董事变更公告》,李瑞麟先生辞去公司董事职务,董事变更实施完毕;

2. 基金管理人于2013年12月28日在指定媒体及公司网站上披露了《工银瑞信基金管理有限公司关于变更法定代表人的公告》,法定代表人变更实施完毕。

**§9 备查文件目录**

1. 中国证监会核准注册的文件

2. 基金合同、基金托管协议、基金招募说明书及基金产品资料概要

3. 基金管理人内部管理制度

4. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

6. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

8. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

9. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

10. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

11. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

12. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

13. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

14. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

15. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

16. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

17. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

18. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

19. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

20. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

21. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

22. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

23. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

24. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

25. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

26. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

27. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

28. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

29. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

30. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

31. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

32. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

33. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

34. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

35. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

36. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

37. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

38. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

39. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

40. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

41. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

42. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

43. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

44. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

45. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

46. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

47. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

48. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

49. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

50. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

51. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

52. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

53. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

54. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

55. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

56. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

57. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

58. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

59. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

60. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

61. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

62. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

63. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

64. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

65. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

66. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

67. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

68. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

69. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

70. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

71. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

72. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

73. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

74. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

75. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

76. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

77. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

78. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

79. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

80. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

81. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

82. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

83. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

84. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

85. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

86. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

87. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

88. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

89. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

90. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

91. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

92. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

93. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

94. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

95. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

96. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

97. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

98. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

99. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

100. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

101. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

102. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

103. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

104. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

105. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

106. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

107. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

108. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

109. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

110. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

111. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

112. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

113. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

114. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

115. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

116. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

117. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

118. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

119. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

120. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

121. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

122. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

123. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

124. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

125. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

126. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

127. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

128. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

129. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

130. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

131. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

132. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

133. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

134. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

135. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

136. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

137. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

138. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

139. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

140. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

141. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

142. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

143. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

144. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

145. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

146. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

147. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

148. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

149. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

150. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

151. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

152. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

153. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

154. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

155. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

156. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

157. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

158. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

159. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

160. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

161. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

162. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

163. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

164. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

165. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

166. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

167. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

168. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

169. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

170. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

171. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

172. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

173. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

174. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

175. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

</