

工银瑞信保本混合型证券投资基金

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。
本基金的基金管理人和基金托管人根据本基金合同的规定，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适宜性等内容，保证复核结果不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。
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10月1日起至12月31日止。

§ 2 基本产品概况

基金简称	工银保本混合
交易代码	487016
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年10月10日
报告期末基金份额总额	1,111,255,754.00份

投资目标 通过资产配置，通过定期比例投资组合保险策略，控制本金损失的风险，力争在基金本金安全的基础上实现基金的增值。

投资策略 通过定期组合保险策略，运用价值投资策略和量化投资策略，实现基金的增值。

业绩比较基准 40%×沪深300定期存款利率

风险收益特征 本基金为保本混合型基金，属货币基金中的低风险收益品种。

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

基金保证人 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

报告期(2013年10月1日-2013年12月31日)

1.本期已实现收益 11,440,228.18

2.本期利润 -3,683,445.05

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0097

4.期末基金份额净值 1,191,224,017.61

5.期末基金份额净值 1.0072

注:①本基金的业绩报酬不包括持有人以认购或交易本基金的费用计算,计入费用后实际收益水平将低于阶段系数。

②本体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利润分配。

③所列数据截至2013年12月31日。

④本基金合同生效以来基金份额净值的年化收益率。

⑤本基金合同生效以来基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

报告期 净值增长率(%) 业绩比较基准收益率(%)

过去三个月 -0.83% 0.10% 1.07% 0.00% -1.90% 0.00%

3.2 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

报告期 净值增长率(%) 业绩比较基准收益率(%)

过去三个月 -0.83% 0.10% 1.07% 0.00% -1.90% 0.00%

基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

报告期 15,910,700.00 1.04

其中:股票 15,910,700.00 1.04

2 固定收益投资 1,469,707,497.20 95.81

其中:债券 1,469,707,497.20 95.81

货币支持券 - -

3 金融衍生品投资 - -

4 买入返售金融资产 - -

其中:质押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 14,242,688.74 0.93

6 其他资产 34,140,880.73 2.23

7 合计 1,534,001,566.67 100.00

注:由于四舍五入的原因基金占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

报告期末基金资产组合

报告期(2013年10月1日-2013年12月31日)

1.股票 11,440,228.18

2.固定收益投资 -11,683,445.05

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0097

4.期末基金份额净值 1,191,224,017.61

5.期末基金份额净值 1.0072

注:①本基金的业绩报酬不包括持有人以认购或交易本基金的费用计算,计入费用后实际收益水平将低于阶段系数。

②本体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利润分配。

③所列数据截至2013年12月31日。

④本基金合同生效以来基金份额净值的年化收益率。

⑤本基金合同生效以来基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

报告期 净值增长率(%) 业绩比较基准收益率(%)

过去三个月 -0.83% 0.10% 1.07% 0.00% -1.90% 0.00%

基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

报告期 15,910,700.00 1.04

其中:股票 15,910,700.00 1.04

2 固定收益投资 1,469,707,497.20 95.81

其中:债券 1,469,707,497.20 95.81

货币支持券 - -

3 金融衍生品投资 - -

4 买入返售金融资产 - -

其中:质押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 14,242,688.74 0.93

6 其他资产 34,140,880.73 2.23

7 合计 1,534,001,566.67 100.00

注:由于四舍五入的原因基金占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

报告期末基金资产组合

报告期(2013年10月1日-2013年12月31日)

1.股票 11,440,228.18

2.固定收益投资 -11,683,445.05

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0097

4.期末基金份额净值 1,191,224,017.61

5.期末基金份额净值 1.0072

注:①本基金的业绩报酬不包括持有人以认购或交易本基金的费用计算,计入费用后实际收益水平将低于阶段系数。

②本体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利润分配。

③所列数据截至2013年12月31日。

④本基金合同生效以来基金份额净值的年化收益率。

⑤本基金合同生效以来基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

报告期 净值增长率(%) 业绩比较基准收益率(%)

过去三个月 -0.83% 0.10% 1.07% 0.00% -1.90% 0.00%

基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

报告期 15,910,700.00 1.04

其中:股票 15,910,700.00 1.04

2 固定收益投资 1,469,707,497.20 95.81

其中:债券 1,469,707,497.20 95.81

货币支持券 - -

3 金融衍生品投资 - -

4 买入返售金融资产 - -

其中:质押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 14,242,688.74 0.93

6 其他资产 34,140,880.73 2.23

7 合计 1,534,001,566.67 100.00

注:由于四舍五入的原因基金占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

报告期末基金资产组合

报告期(2013年10月1日-2013年12月31日)

1.股票 11,440,228.18

2.固定收益投资 -11,683,445.05

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0097

4.期末基金份额净值 1,191,224,017.61

5.期末基金份额净值 1.0072

注:①本基金的业绩报酬不包括持有人以认购或交易本基金的费用计算,计入费用后实际收益水平将低于阶段系数。

②本体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利润分配。

③所列数据截至2013年12月31日。

④本基金合同生效以来基金份额净值的年化收益率。

⑤本基金合同生效以来基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

报告期 净值增长率(%) 业绩比较基准收益率(%)

过去三个月 -0.83% 0.10% 1.07% 0.00% -1.90% 0.00%

基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

报告期 15,910,700.00 1.04

其中:股票 15,910,700.00 1.04

2 固定收益投资 1,469,707,497.20 95.81

其中:债券 1,469,707,497.20 95.81

货币支持券 - -

3 金融衍生品投资 - -

4 买入返售金融资产 - -

其中:质押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 14,242,688.74 0.93

6 其他资产 34,140,880.73 2.23

7 合计 1,534,001,566.67 100.00

注:由于四舍五入的原因基金占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

报告期末基金资产组合

报告期(2013年10月1日-2013年12月31日)

1.股票 11,440,228.18

2.固定收益投资 -11,683,445.05

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0097

4.期末基金份额净值 1,191,224,017.61

5.期末基金份额净值 1.0072

注:①本基金的业绩报酬不包括持有人以认购或交易本基金的费用计算,计入费用后实际收益水平将低于阶段系数。