

## 工银瑞信增利分级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:招商银行股份有限公司  
报告期截止日: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。

基金托管人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，但不对基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资人投资于本基金前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期自2013年10月1日起至12月31日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	工银增利分级债券(内含简称:工银增利)
交易代码	166812
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年5月6日
报告期末基金份额总额	1,106,10,056,465份
投资目标	在控制风险并保持资产流动性的基础上,满足到期A份额持有人的稳健收益流动性需求,同时满足到期B份额持有人在承担适当风险的基础上,获取更多收益的需求。
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	定期存款利率+1.5%
风险收益特征	从基金整体运作来看,本基金为债券型基金,属于低风险基金产品,其预期收益率和预期风险均低于股票型基金、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	招商银行股份有限公司
下属两级基金的基金简称	工银增A 工银增B
下属两级基金的交易代码	166813 150128
报告期末二级基金的份额总额	484,726,028.86份 621,384,035.67份
下属两级基金的风险收益特征	增加A份额将体现较高的风险,赎回和B份额将体现出现高风险,收益的波动性将大于B份额;赎回和B份额将体现出现高风险,收益的波动性将小于B份额。

## §3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标	报告期(2013年10月1日 - 2013年12月31日)	
	单位:人民币元	
1.本期已实现收益	5,554,101.57	
2.本期利润	-75,551,982.39	
3.期末平均基金份额本期利润	-0.0683	
4.期末基金份额净值	981,263,732.18	
5.期末基金份额净值	0.887	

注:(1)本基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计价费用后实际收益水平将低于所列数字。

(2)“本期利润”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,即为本期利润,亦为本期已实现收益。

(3)本基金于2013年5月5日进行份额折算。

(4)期末数据折算后2013年12月31日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本基金报告期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(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益(%) 收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -7.12% 0.22% 1.48% 0.02% -8.57% 0.20%

3.2.2 本基金合同生效以来基金累计净值增长率变化与其同期业绩比较基准收益率变化的比较

基金成立以来净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对照图

注:由于四舍五入的原因部分基金占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

3.3 主要财务指标

3.3.1 报告期各项目金额单位:人民币元

3.3.2 报告期各项目金额单位:人民币元

3.3.3 其他指标

3.3.4 其他指标

3.3.5 其他指标

3.3.6 其他指标

3.3.7 其他指标

3.3.8 其他指标

3.3.9 其他指标

3.3.10 其他指标

3.3.11 其他指标

3.3.12 其他指标

3.3.13 其他指标

3.3.14 其他指标

3.3.15 其他指标

3.3.16 其他指标

3.3.17 其他指标

3.3.18 其他指标

3.3.19 其他指标

3.3.20 其他指标

3.3.21 其他指标

3.3.22 其他指标

3.3.23 其他指标

3.3.24 其他指标

3.3.25 其他指标

3.3.26 其他指标

3.3.27 其他指标

3.3.28 其他指标

3.3.29 其他指标

3.3.30 其他指标

3.3.31 其他指标

3.3.32 其他指标

3.3.33 其他指标

3.3.34 其他指标

3.3.35 其他指标

3.3.36 其他指标

3.3.37 其他指标

3.3.38 其他指标

3.3.39 其他指标

3.3.40 其他指标

3.3.41 其他指标

3.3.42 其他指标

3.3.43 其他指标

3.3.44 其他指标

3.3.45 其他指标

3.3.46 其他指标

3.3.47 其他指标

3.3.48 其他指标

3.3.49 其他指标

3.3.50 其他指标

3.3.51 其他指标

3.3.52 其他指标

3.3.53 其他指标

3.3.54 其他指标

3.3.55 其他指标

3.3.56 其他指标

3.3.57 其他指标

3.3.58 其他指标

3.3.59 其他指标

3.3.60 其他指标

3.3.61 其他指标

3.3.62 其他指标

3.3.63 其他指标

3.3.64 其他指标

3.3.65 其他指标

3.3.66 其他指标

3.3.67 其他指标

3.3.68 其他指标

3.3.69 其他指标

3.3.70 其他指标

3.3.71 其他指标

3.3.72 其他指标

3.3.73 其他指标

3.3.74 其他指标

3.3.75 其他指标

3.3.76 其他指标

3.3.77 其他指标

3.3.78 其他指标

3.3.79 其他指标

3.3.80 其他指标

3.3.81 其他指标

3.3.82 其他指标

3.3.83 其他指标

3.3.84 其他指标

3.3.85 其他指标

3.3.86 其他指标

3.3.87 其他指标

3.3.88 其他指标

3.3.89 其他指标

3.3.90 其他指标

3.3.91 其他指标

3.3.92 其他指标

3.3.93 其他指标

3.3.94 其他指标

3.3.95 其他指标

3.3.96 其他指标

3.3.97 其他指标

3.3.98 其他指标

3.3.99 其他指标

3.3.100 其他指标

3.3.101 其他指标

3.3.102 其他指标

3.3.103 其他指标

3.3.104 其他指标

3.3.105 其他指标

3.3.106 其他指标

3.3.107 其他指标

3.3.108 其他指标

3.3.109 其他指标

3.3.110 其他指标

3.3.111 其他指标

3.3.112 其他指标

3.3.113 其他指标

3.3.114 其他指标

3.3.115 其他指标

3.3.116 其他指标