

工银瑞信保本3号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：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监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、完整性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人和银行股份有限公司根据本基金合同规定，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报告等数据，保证复核结果与本基金管理人计算的结果一致。

基金托管人承诺以诚实信用、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3号混合
交易代码	000195
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年6月26日
报告期末基金份额总额	427,887,404.50份
投资目标	依照保本原则，通过运用比例化投资组合保险策略，控制本基金的低风险和低收益，使本基金在基本的投资原则上实现保本增值的回报。
投资策略	本基金采用恒定比例保险组合策略，通过定期调整资产配置比例，使本基金在基本的投资原则上实现保本增值的回报。
业绩比较基准	人民币银行同期一年定期存款利率+0.25%
风险收益特征	本基金是一只保本型基金，属于基金中的低风险品种。投资的风险主要来自于股票、债券等金融工具的波动。本基金将通过投资于股票、债券等金融工具，使本基金在基本的投资原则上实现保本增值的回报。
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
基金保证人	中海信托股份有限公司
下属分级基金的基金简称	工银保本3号混合 A 工银保本3号混合 B
下属分级基金的交易代码	000195 000196
报告期下两个季度基金的份额总额	183,463,378.51份 244,424,025.99份

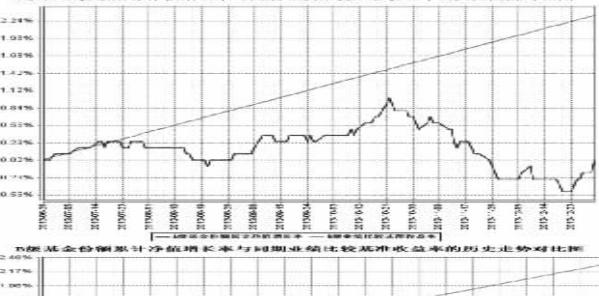
§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

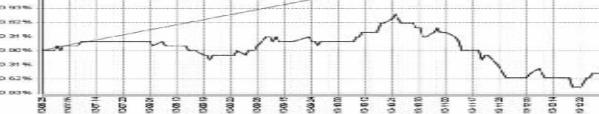
主要财务指标	报告期(2013年10月1日 - 2013年12月31日)			
	工银保本3号混合 A	工银保本3号混合 B	1.本期已实现收益	2,040,441.15
2.本期利润	-713,403.34	-1,659,172.33	3.加权平均基金份额本期利润	-0.0038
4.期末基金份额净值	183,435,639.93	243,508,329.15	5.期末基金资产净值	1,000 0.997

(注：1)本基金业经审计的各项目的各项费用，计入费用后仍为收益水平以货币所列示数字。
 2)本期利润未包含持有人未确认的利息收入，按摊余成本法计算。
 3)所列数据截止到2013年12月31日。
 3.2 基金的净值表现
 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 (准差率②)	业绩比较基准收益 率(标准差③)	①-③ (②-④)
过去三个月	-0.40%	0.09%	1.13%	0.01% -1.53% 0.08%

 3.2.2 日均百分比增长率为基金净值增长率变动幅度及与同期业绩比较基准收益率变动幅度的比较


3.3 基金业经审计的最近三个季度的比较本期收益表现的比率图



3.4 管理人报告

4.1 基金管理人对报告期内本基金运作合规情况的说明
任本基金的基金经理期限 任职日期 离任日期 说明
固定收益部 欧欣凯 2013年6月26日 - 担任中海基金管理有限公司基金经理； 2010年8月26日至2013年6月26日担任工银保本3号混合基金经理；2011年12月27日至今年担任工银保本3号混合基金经理；2013年2月1日至今年担任工银保本3号混合型发起式基金基金经理；2013年5月5日至今年担任工银保本3号混合型发起式基金经理。
王勇 本基金的基金经理 2013年6月26日 - 担任中海基金管理有限公司基金经理； 2010年1月12日至今年担任工银保本3号混合型发起式基金经理；2013年6月16日起至今担任工银瑞信保本3号混合型基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规情况的说明

1)基金管理人严格按照有关法律法规及基金合同的规定，履行了向基金持有人披露信息的义务，没有损害基金持有人的利益。
 2)本基金合同规范，基金合同符合相关法律法规的规定。
 3)在报告期报告期内，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的规定，股票等资产占基金资产的比例不高，40%，债券回购、货币市场工具等资产占基金资产的比例不低于60%，本基金在开放期内，每份收益以日在申购扣款日后的次一工作日的收益为准，而在申购期内，本基金持有现金或者将在一日之内持有的货币资金占基金资产净值的比例不受限制。
 3.3 其他指标

4.3 管理人对报告期内本基金运作合规情况的说明

1)基金管理人严格按照有关法律法规及基金合同的规定，履行了向基金持有人披露信息的义务，没有损害基金持有人的利益。
 2)本基金合同规范，基金合同符合相关法律法规的规定。
 3)在报告期报告期内，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的规定，股票等资产占基金资产的比例不高，40%，债券回购、货币市场工具等资产占基金资产的比例不低于60%，本基金在开放期内，每份收益以日在申购扣款日后的次一工作日的收益为准，而在申购期内，本基金持有现金或者将在一日之内持有的货币资金占基金资产净值的比例不受限制。
 3.3 其他指标

4.4 管理人对报告期内本基金运作合规情况的说明

本基金报告期内外出现异常交易的情况。在报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价区间内反向交易成

4.5 管理人对报告期内本基金运作合规情况的说明

本基金报告期内外出现异常交易的情况。在报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价区间内反向交易成

4.6 管理人对报告期内本基金运作合规情况的说明

本基金报告期内外出现异常交易的情况。在报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价区间内反向交易成

4.7 管理人对报告期内本基金运作合规情况的说明

本基金报告期内外出现异常交易的情况。在报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价区间内反向交易成

4.8 管理人对报告期内本基金运作合规情况的说明

本基金报告期内外出现异常交易的情况。在报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价区间内反向交易成

4.9 管理人对报告期内本基金运作合规情况的说明

本基金报告期内外出现异常交易的情况。在报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价区间内反向交易成

4.10 管理人对报告期内本基金运作合规情况的说明

本基金报告期内外出现异常交易的情况。在报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价区间内反向交易成

4.11 管理人对报告期内本基金运作合规情况的说明

本基金报告期内外出现异常交易的情况。在报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价区间内反向交易成

4.12 管理人对报告期内本基金运作合规情况的说明

本基金报告期内外出现异常交易的情况。在报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价区间内反向交易成

4.13 管理人对报告期内本基金运作合规情况的说明

本基金报告期内外出现异常交易的情况。在报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价区间内反向交易成

4.14 管理人对报告期内本基金运作合规情况的说明

本基金报告期内外出现异常交易的情况。在报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价区间内反向交易成

4.15 管理人对报告期内本基金运作合规情况的说明

本基金报告期内外出现异常交易的情况。在报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价区间内反向交易成

4.16 管理人对报告期内本基金运作合规情况的说明

本基金报告期内外出现异常交易的情况。在报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价区间内反向交易成

4.17 管理人对报告期内本基金运作合规情况的说明

本基金报告期内外出现异常交易的情况。在报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价区间内反向交易成

4.18 管理人对报告期内本基金运作合规情况的说明

本基金报告期内外出现异常交易的情况。在报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价区间内反向交易成

4.19 管理人对报告期内本基金运作合规情况的说明

本基金报告期内外出现异常交易的情况。在报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价区间内反向交易成

4.20 管理人对报告期内本基金运作合规情况的说明

本基金报告期内外出现异常交易的情况。在报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价区间内反向交易成

4.21 管理人对报告期内本基金运作合规情况的说明

本基金报告期内外出现异常交易的情况。在报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价区间内反向交易成

4.22 管理人对报告期内本基金运作合规情况的说明

本基金报告期内外出现异常交易的情况。在报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价区间内反向交易成

4.23 管理人对报告期内本基金运作合规情况的说明

本基金报告期内外出现异常交易的情况。在报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价区间内反向交易成

4.24 管理人对报告期内本基金运作合规情况的说明

本基金报告期内外出现异常交易的情况。在报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价区间内反向交易成

4.25 管理人对报告期内本基金运作合规情况的说明

本基金报告期内外出现异常交易的情况。在报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价区间内反向交易成

4.26 管理人对报告期内本基金运作合规情况的说明

本基金报告期内外出现异常交易的情况。在报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价区间内反向交易成

4.27 管理人对报告期内本基金运作合规情况的说明

本基金报告期内外出现异常交易的情况。在报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价区间内反向交易成

4.28 管理人对报告期内本基金运作合规情况的说明

本基金报告期内外出现异常交易的情况。在报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价区间内反向交易成

4.29 管理人对报告期内本基金运作合规情况的说明

本基金报告期内外出现异常交易的情况。在报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价区间内反向交易成

4.30 管理人对报告期内本基金运作合规情况的说明

本基金报告期内外出现异常交易的情况。在报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价区间内反向交易成

4.31 管理人对报告期内本基金运作合规情况的说明

本基金报告期内外出现异常交易的情况。在报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价区间内反向交易成

4.32 管理人对报告期内本基金运作合规情况的说明

本基金报告期内外出现异常交易的情况。在报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价区间内反向交易成

4.33 管理人对报告期内本基金运作合规情况的说明

本基金报告期内外出现异常交易的情况。在报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价区间内反向交易成

4.34 管理人对报告期内本基金运作合规情况的说明

本基金报告期内外出现异常交易的情况。在报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价区间内反向交易成

4.35 管理人对报告期内本基金运作合规情况的说明

本基金报告期内外出现异常交易的情况。在报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价区间内反向交易成

4.36 管理人对报告期内本基金运作合规情况的说明

本基金报告期内外出现异常交易的情况。在报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价区间内反向交易成

4.37 管理人对报告期内本基金运作合规情况的说明

本基金报告期内外出现异常交易的情况。在报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价区间内反向交易成

4.38 管理人对报告期内本基金运作合规情况的说明

本基金报告期内外出现异常交易的情况。在报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价区间内反向交易成

4.39 管理人对报告期内本基金运作合规情况的说明

本基金报告期内外出现异常交易的情况。在报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价区间内反向交易成

4.40 管理人对报告期内本基金运作合规情况的说明

本基金报告期内外