

工银瑞信四季收益债券型证券投资基金

[2012] 第三季度报告

基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一二年十月二十五日

§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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2012年10月23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。投资人投资于基金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2012年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称 工银四季收益债券

交易代码 164808

基金运作方式 上市契约型开放式(LOF)

基金合同生效日 2011年7月10日

报告期末基金份额总额 2,403,461,626.69份

投资目标 在严格控制风险与保持资产流动性的基础上,追求基金资产的长期稳定增值。

本基金将深入分析固定收益品种的投资价值的基础上,采用久期管理等策略,构建债券组合,通过重点投资企业债、金融债、短期融资券、可转换债券、可分离债、企业债、国债、地方政府债、中期票据、短期融资券、资产支持证券等投资方

投资策略 式来提高基金收益率。

本基金将保持较高的信用债仓位,适当增加中等级信用债配置,对可转债进行波段操作。

业绩比较基准 三年定期存款利率+1.8%。

3.1 主要财务指标

主要财务指标 报告期(2012年7月1日—2012年9月30日)

1.本期已实现收益 84,000,141.81

2.本期利润 25,014,391.10

3.加权平均基金份额本期利润 0.0104

4.期末基金份额净值 2,566,515,298.31

5.期末基金份额总额 1,068

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纯利数字。

②“期初已实现收益”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2012年9月30日。

3.2 基金净值表现

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

过去三个月 1.02% 0.10% 1.53% 0.01% -0.51% 0.09%

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

图示: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。

5.5 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股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

5.7 报告组合投资附注

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 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。

5.8.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股股票。

5.8.3 其他资产构成

1 存出保证金 263,247.39

2 应收证券清算款 30,250,748.95

3 应收利息 90,344,329.24

4 应收申购款 -

5 其他应收款 -

7 待摊费用 -

8 其他 -

9 合计 120,858,325.58

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号 债券代码 债券名称 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 110216 中行转债 3,500,000 13.72

2 130001 中行转债 192,777,721.60 7.51

3 126011 08石化债 1,267,060 4.71

4 122079 11上汽02 1,009,740 4.01

5 118007 11招行转债 1,000,000 100,970,000.00 3.93

5.8.5 报告期末前十名股票存在流通受限情况的说明

本基金报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.8.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

6 报告期内开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额 2,403,461,626.69

本报告期基金份额变动情况 -

减:本期报告期基金份额总额 0

本报告期期末基金份额总额 2,403,461,626.69

本报告期末基金份额总额 0

注: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纯利数字。

2. “期初已实现收益”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2012年9月30日。

3.2 基金净值表现

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

过去三个月 -0.60% 0.19% 1.58% 0.01% -2.26% 0.18%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

图示:自基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:①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。

4.4 报告期内基金的经营情况

4.4.1 公平交易制度的执行情况

为了公平对待所有客户,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》、《证券投资基金托管协议》、《证券投资基金费率计提方法》等有关规定,制定了《公平交易管理制度》、《公平交易管理办法》、《公平交易操作规程》和公司内部规章,拟定了《公平交易管理办法》、《公平交易管理办法》、《公平交易操作规程》,对公司管理的各类资产的公平对待做出了具体的规定,并规定对买卖股票、债券等资产的价格偏离度、市场地位、价格优势等方面进行监控,对买卖股票、债券等资产的价格偏离度、市场地位、价格优势等方面,可能存在操纵股价、利益输送等违法违规情况进行监控。报告期内时间优先、价格优先的原则,本公司对满足限售条件且对同一证券有相对交易需求的基金等投资组合,均采用了系统的公平交易模块进行操作,实现了公平交易,未出现清算不均衡的情况,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。

4.4.2 公平交易制度的执行情况

为了公平对待所有客户,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》、《证券投资基金托管协议》、《证券投资基金费率计提方法》等有关规定,制定了《公平交易管理制度》、《公平交易管理办法》、《公平交易操作规程》和公司内部规章,拟定了《公平交易管理办法》、《公平交易管理办法》、《公平交易操作规程》,对公司管理的各类资产的公平对待做出了具体的规定,并规定对买卖股票、债券等资产的价格偏离度、市场地位、价格优势等方面进行监控,对买卖股票、债券等资产的价格偏离度、市场地位、价格优势等方面,可能存在操纵股价、利益输送等违法违规情况进行监控。报告期内时间优先、价格优先的原则,本公司对满足限售条件且对同一证券有相对交易需求的基金等投资组合,均采用了系统的公平交易模块进行操作,实现了公平交易,未出现清算不均衡的情况,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。

4.4.3 公平交易制度的执行情况

为了公平对待所有客户,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》、《证券投资基金托管协议》、《证券投资基金费率计提方法》等有关规定,制定了《公平交易管理制度》、《公平交易管理办法》、《公平交易操作规程》和公司内部规章,拟定了《公平交易管理办法》、《公平交易管理办法》、《公平交易操作规程》,对公司管理的各类资产的公平对待做出了具体的规定,并规定对买卖股票、债券等资产的价格偏离度、市场地位、价格优势等方面进行监控,对买卖股票、债券等资产的价格偏离度、市场地位、价格优势等方面,可能存在操纵股价、利益输送等违法违规情况进行监控。报告期内时间优先、价格优先的原则,本公司对满足限售条件且对同一证券有相对交易需求的基金等投资组合,均采用了系统的公平交易模块进行操作,实现了公平交易,未出现清算不均衡的情况,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。

4.4.4 公平交易制度的执行情况

为了公平对待所有客户,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》、《证券投资基金托管协议》、《证券投资基金费率计提方法》等有关规定,制定了《公平交易管理制度》、《公平交易管理办法》、《公平交易操作规程》和公司内部规章,拟定了《公平交易管理办法》、《公平交易管理办法》、《公平交易操作规程》,对公司管理的各类资产的公平对待做出了具体的规定,并规定对买卖股票、债券等资产的价格偏离度、市场地位、价格优势等方面进行监控,对买卖股票、债券等资产的价格偏离度、市场地位、价格优势等方面,可能存在操纵股价、利益输送等违法违规情况进行监控。报告期内时间优先、价格优先的原则,本公司对满足限售条件且对同一证券有相对交易需求的基金等投资组合,均采用了系统的公平交易模块进行操作,实现了公平交易,未出现清算不均衡的情况,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。

4.4.5 公平交易制度的执行情况

为了公平对待所有客户,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》、《证券投资基金托管协议》、《证券投资基金费率计提方法》等有关规定,制定了《公平交易管理制度》、《公平交易管理办法》、《公平交易操作规程》和公司内部规章,拟定了《公平交易管理办法》、《公平交易管理办法》、《公平交易操作规程》,对公司管理的各类资产的公平对待做出了具体的规定,并规定对买卖股票、债券等资产的价格偏离度、市场地位、价格优势等方面进行监控,对买卖股票、债券等资产的价格偏离度、市场地位、价格优势等方面,可能存在操纵股价、利益输送等违法违规情况进行监控。报告期内时间优先、价格优先的原则,本公司对满足限售条件且对同一证券有相对交易需求的基金等投资组合,均采用了系统的公平交易模块进行操作,实现了公平交易,未出现清算不均衡的情况,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。

4.4.6 公平交易制度的执行情况

为了公平对待所有客户,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》、《证券投资基金托管协议》、《证券投资基金费率计提方法》等有关规定,制定了《公平交易管理制度》、《公平交易管理办法》、《公平交易操作规程》和公司内部规章,拟定了《公平交易管理办法》、《公平交易管理办法》、《公平交易操作规程》,对公司管理的各类资产的公平对待做出了具体的规定,并规定对买卖股票、债券等资产的价格偏离度、市场地位、价格优势等方面进行监控,对买卖股票、债券等资产的价格偏离度、市场地位、价格优势等方面,可能存在操纵股价、利益输送等违法违规情况进行监控。报告期内时间优先、价格优先的原则,本公司对满足限售条件且对同一证券有相对交易需求的基金等投资组合,均采用了系统的公平交易模块进行操作,实现了公平交易,未出现清算不均衡的情况,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。

4.4.7 公平交易制度的执行情况

为了公平对待所有客户,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》、《证券投资基金托管协议》、《证券投资基金费率计提方法》等有关规定,制定了《公平交易管理制度》、《公平交易管理办法》、《公平交易操作规程》和公司内部规章,拟定了《公平交易管理办法》、《公平交易管理办法》、《公平交易操作规程》,对公司管理的各类资产的公平对待做出了具体的规定,并规定对买卖股票、债券等资产的价格偏离度、市场地位、价格优势等方面进行监控,对买卖股票、债券等资产的价格偏离度、市场地位、价格优势等方面,可能存在操纵股价、利益输送等违法违规情况进行监控。报告期内时间优先、价格优先的原则,本公司对满足限售条件且对同一证券有相对交易需求的基金等投资组合,均采用了系统的公平交易模块进行操作,实现了公平交易,未出现清算不均衡的情况,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。

4.4.8 公平交易制度的执行情况

为了公平对待所有客户,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》、《证券投资基金托管协议》、《证券投资基金费率计提方法》等有关规定,制定了《公平交易管理制度》、《公平交易管理办法》、《公平交易操作规程》和公司内部规章,拟定了《公平交易管理办法》、《公平交易管理办法》、《公平交易操作规程》,对公司管理的各类资产的公平对待做出了具体的规定,并规定对买卖股票、债券等资产的价格偏离度、市场地位、价格优势等方面进行监控,对买卖股票、债券等资产的价格偏离度、市场地位、价格优势等方面,可能存在操纵股价、利益输送等违法违规情况进行监控。报告期内时间优先、价格优先的原则,本公司对满足限售条件且对同一证券有相对交易需求的基金等投资组合,均采用了系统的公平交易模块进行操作,实现了公平交易,未出现清算不均衡的情况,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。

4.4.9 公平交易制度的执行情况

为了公平对待所有客户,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》、《证券投资基金托管协议》、《证券投资基金费率计提方法》等有关规定,制定了《公平交易管理制度》、《公平交易管理办法》、《公平交易操作规程》和公司内部规章,拟定了《公平交易管理办法》、《公平交易管理办法》、《公平交易操作规程》,对公司管理的各类资产的公平对待做出了具体的规定,并规定对买卖股票、债券等资产的价格偏离度、市场地位、价格优势等方面进行监控,对买卖股票、债券等资产的价格偏离度、市场地位、价格优势等方面,可能存在操纵股价、利益输送等违法违规情况进行监控。报告期内时间优先、价格优先的原则,本公司对满足限售条件且对同一证券有相对交易需求的基金等投资组合,均采用了系统的公平交易模块进行操作,实现了公平交易,未出现清算不均衡的情况,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。

4.4.10 公平交易制度的执行情况

为了公平对待所有客户,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。