

工银瑞信双利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:交通银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一二年十月二十五日

重要提示

基金管理人的董事及董事会所制作的报告不存在虚假记载、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。

基金托管人对本基金合同所载内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金销售机构承诺以诚实信用、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2012年7月1日起至2012年9月30日止。

5.2 基金产品概况

基金简称:工银瑞信双利债券型证券投资基金

基金代码:485111

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2010年8月16日

报告期末基金份额总额:2,442,309,895.14份

投资目标:在适度承担风险以保持资产流动性的基础上，通过配置债券等固定收益类资产，追求基金资产的长期稳定增值，通过适度配置股票等权益类资产，追求基金资产的中长期资本增值。

投资策略:本基金将资产配置策略的基础上，通过固定收益类资产投资策略和股票类资产投资策略，实现基金资产的中长期资本增值。

业绩比较基准:中债综合全价指数收益率

风险收益特征:本基金为债券型基金，预期收益和风险水平高于货币市场基金，低于混合型基金及股票基金，风险收益特征为中等风险，中等收益。

基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司

基金托管人:交通银行股份有限公司

基金销售机构:工银瑞信基金管理有限公司

基金代销机构:工银瑞信基金管理有限公司

基金募集的交易代码:485111

报告期末基金份额总额:1,460,408,312.14份

基金募集的份额总额:1,081,901,583.03份

5.3 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2012年7月1日-2012年9月30日)

工银瑞信双利债券 A 工银瑞信双利债券 B

1.本期已实现收益 31,821,442.94 29,720,861.39

2.本期利润 -9,817,600.54 -6,848,804.21

3.期初平均基金份额总额 -0.0079 -0.0062

4.期末基金资产净值 1,515,376,548.76 1,193,943,111.70

5.期末基金份额净值 1.1141 1.1040

注:1.本基金业绩比较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将低于所示数字。

2. “本期已实现收益”指基金本期利润收入、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.基金募集的交易代码:485111

4.期末基金资产净值:1,460,408,312.14份

5.报告期末基金份额总额:1,081,901,583.03份

5.4 报告期末基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

工银瑞信双利债券 A

阶段 净值增长率(%) 净值增长率(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准准差(%) (1)-(3) (2)-(4)

过去三个月 -0.45% 0.15% -0.15% 0.05% -0.30% 0.10%

5.2.2 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

工银瑞信双利债券 A

阶段 净值增长率(%) 净值增长率(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准准差(%) (1)-(3) (2)-(4)

过去三个月 -0.54% 0.15% -0.15% 0.05% -0.39% 0.10%

5.3.3 其他指标

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

工银瑞信双利债券 A

阶段 净值增长率(%) 净值增长率(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准准差(%) (1)-(3) (2)-(4)

过去三个月 -0.45% 0.15% -0.15% 0.05% -0.30% 0.10%

5.3.4 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变动的比较

工银瑞信双利债券 A

阶段 净值增长率(%) 净值增长率(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准准差(%) (1)-(3) (2)-(4)

过去三个月 -0.45% 0.15% -0.15% 0.05% -0.30% 0.10%

5.3.5 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变动的比较

工银瑞信双利债券 A

阶段 净值增长率(%) 净值增长率(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准准差(%) (1)-(3) (2)-(4)

过去三个月 -0.45% 0.15% -0.15% 0.05% -0.30% 0.10%

5.3.6 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变动的比较

工银瑞信双利债券 A

阶段 净值增长率(%) 净值增长率(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准准差(%) (1)-(3) (2)-(4)

过去三个月 -0.45% 0.15% -0.15% 0.05% -0.30% 0.10%

5.3.7 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变动的比较

工银瑞信双利债券 A

阶段 净值增长率(%) 净值增长率(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准准差(%) (1)-(3) (2)-(4)

过去三个月 -0.45% 0.15% -0.15% 0.05% -0.30% 0.10%

5.3.8 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变动的比较

工银瑞信双利债券 A

阶段 净值增长率(%) 净值增长率(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准准差(%) (1)-(3) (2)-(4)

过去三个月 -0.45% 0.15% -0.15% 0.05% -0.30% 0.10%

5.3.9 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变动的比较

工银瑞信双利债券 A

阶段 净值增长率(%) 净值增长率(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准准差(%) (1)-(3) (2)-(4)

过去三个月 -0.45% 0.15% -0.15% 0.05% -0.30% 0.10%

5.3.10 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变动的比较

工银瑞信双利债券 A

阶段 净值增长率(%) 净值增长率(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准准差(%) (1)-(3) (2)-(4)

过去三个月 -0.45% 0.15% -0.15% 0.05% -0.30% 0.10%

5.3.11 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变动的比较

工银瑞信双利债券 A

阶段 净值增长率(%) 净值增长率(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准准差(%) (1)-(3) (2)-(4)

过去三个月 -0.45% 0.15% -0.15% 0.05% -0.30% 0.10%

5.3.12 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变动的比较

工银瑞信双利债券 A

阶段 净值增长率(%) 净值增长率(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准准差(%) (1)-(3) (2)-(4)

过去三个月 -0.45% 0.15% -0.15% 0.05% -0.30% 0.10%

5.3.13 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变动的比较

工银瑞信双利债券 A

阶段 净值增长率(%) 净值增长率(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准准差(%) (1)-(3) (2)-(4)

过去三个月 -0.45% 0.15% -0.15% 0.05% -0.30% 0.10%

5.3.14 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变动的比较

工银瑞信双利债券 A

阶段 净值增长率(%) 净值增长率(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准准差(%) (1)-(3) (2)-(4)

过去三个月 -0.45% 0.15% -0.15% 0.05% -0.30% 0.10%

5.3.15 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变动的比较

工银瑞信双利债券 A

阶段 净值增长率(%) 净值增长率(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准准差(%) (1)-(3) (2)-(4)

过去三个月 -0.45% 0.15% -0.15% 0.05% -0.30% 0.10%

5.3.16 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变动的比较

工银瑞信双利债券 A

阶段 净值增长率(%) 净值增长率(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准准差(%) (1)-(3) (2)-(4)

过去三个月 -0.45% 0.15% -0.15% 0.05% -0.30% 0.10%

5.3.17 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变动的比较

工银瑞信双利债券 A

阶段 净值增长率(%) 净值增长率(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准准差(%) (1)-(3) (2)-(4)

过去三个月 -0.45% 0.15% -0.15% 0.05% -0.30% 0.10%

5.3.18 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变动的比较

工银瑞信双利债券 A

阶段 净值增长率(%) 净值增长率(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准准差(%) (1)-(3) (2)-(4)

过去三个月 -0.45% 0.15% -0.15% 0.05% -0.30% 0.10%

5.3.19 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变动的比较

工银瑞信双利债券 A

阶段 净值增长率(%) 净值增长率(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准准差(%) (1)-(3) (2)-(4)

过去三个月 -0.45% 0.15% -0.15% 0.05% -0.30% 0.10%

5.3.20 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变动的比较

工银瑞信双利债券 A

阶段 净值增长率(%) 净值增长率(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准准差(%) (1)-(3) (2)-(4)

过去三个月 -0.45% 0.15% -0.15% 0.05% -0.30% 0.10%

5.3.21 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变动的比较

工银瑞信双利债券 A

阶段 净值增长率(%) 净值增长率(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准准差(%) (1)-(3) (2)-(4)

过去三个月 -0.45% 0.15% -0.15% 0.05% -0.30% 0.10%

5.3.22 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变动的比较

工银瑞信双利债券 A

阶段 净值增长率(%) 净值增长率(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准准差(%) (1)-(3) (2)-(4)

过去三个月 -0.45% 0.15% -0.15% 0.05% -0.30% 0.10%

5.3.23 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变动的比较

工银瑞信双利债券 A

阶段 净值增长率(%) 净值增长率(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准准差(%) (1)-(3) (2)-(4)

过去三个月 -0.45% 0.15% -0.15% 0.05% -0.30% 0.10%

5.3.24 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变动的比较

工银瑞信双利债券 A

阶段 净值增长率(%) 净值增长率(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准准差(%) (1)-(3) (2)-(4)

过去三个月 -0.45% 0.15% -0.15% 0.05% -0.30% 0.10%

5.3.25 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变动的比较

工银瑞信双利债券 A

阶段 净值增长率(%) 净值增长率(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准准差(%) (1)-(3) (2)-(4)

过去三个月 -0.45% 0.15% -0.15% 0.05% -0.30% 0.10%

5.3.26 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变动的比较

工银瑞信双利债券 A

阶段 净值增长率(%) 净值增长率(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准准差(%) (1)-(3) (2)-(4)

过去三个月 -0.45% 0.15% -0.15% 0.05% -0.30%