

工银瑞信睿智深证100指数分级证券投资基金

2013 第一季度报告

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:二〇一三年四月二十二日

重要提示
基金管理人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。

基金管理人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年4月18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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。投资者在作出投资决策前请仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期末基金资产净值:58,940,337.90元
本报告期末基金份额总额:200,847,141.20份

投资目标
本基金采取主动投资策略,通过控制基金投资组合相对于标的指数的偏离度,实现对标的指数的有效跟踪,通过产品分级设置,为不同份额投资者提供具有差异化收益和风险特征的投资工具。

业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:深证100指数收益率\*95%+商业银行税后活期存款利率\*5%

风险收益特征
本基金属于股票型基金,其预期风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。此外,本基金作为主动管理型基金,采用完全复制策略,跟踪标的指数的市场表现,目标为获取市场平均收益,是股票基金中处于中等风险水平的基金产品。

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

主要财务指标
报告期(2013年1月1日至2013年3月31日)
1.本期已实现收益:5,793,002.50
2.本期利润:1,001,095.76

3.加权平均基金份额本期利润:0.0159
4.期末基金资产净值:62,368,878.08
5.期末基金份额净值:1.0822

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,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

本基金本报告期末未持有股票、权证、股指期货、国债期货、股指期货、权证、股指期货、国债期货、股指期货、权证、股指期货、国债期货。

本基金本报告期末未持有资产支持证券。
本基金本报告期末未持有资产支持证券。

本基金本报告期末未持有权证。
本基金本报告期末未持有权证。

本基金本报告期末未持有资产支持证券。
本基金本报告期末未持有资产支持证券。

误产生的主要原因:1)申购赎回的影响;2)成份股票的停牌;3)指数中成份股票的调整等。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现
本报告期末本基金净值增长率为-0.07%,业绩比较基准收益率为0.28%。

4.5 管理人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。

基金管理人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年4月18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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。投资者在作出投资决策前请仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期末基金资产净值:58,940,337.90元
本报告期末基金份额总额:200,847,141.20份

投资目标
本基金采取主动投资策略,通过控制基金投资组合相对于标的指数的偏离度,实现对标的指数的有效跟踪,通过产品分级设置,为不同份额投资者提供具有差异化收益和风险特征的投资工具。

业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:深证100指数收益率\*95%+商业银行税后活期存款利率\*5%

风险收益特征
本基金属于股票型基金,其预期风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。此外,本基金作为主动管理型基金,采用完全复制策略,跟踪标的指数的市场表现,目标为获取市场平均收益,是股票基金中处于中等风险水平的基金产品。

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

主要财务指标
报告期(2013年1月1日至2013年3月31日)
1.本期已实现收益:5,793,002.50
2.本期利润:1,001,095.76

3.加权平均基金份额本期利润:0.0159
4.期末基金资产净值:62,368,878.08
5.期末基金份额净值:1.0822

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,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

本基金本报告期末未持有股票、权证、股指期货、国债期货、股指期货、权证、股指期货、国债期货。

本基金本报告期末未持有资产支持证券。
本基金本报告期末未持有资产支持证券。

工银瑞信信用添利债券型证券投资基金

2013 第一季度报告

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:二〇一三年四月二十二日

重要提示
基金管理人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。

基金管理人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年4月18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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。投资者在作出投资决策前请仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期末基金资产净值:1,244,787,999.84元
本报告期末基金份额总额:1,244,787,999.84份

投资目标
本基金采取主动投资策略,通过控制基金投资组合相对于标的指数的偏离度,实现对标的指数的有效跟踪,通过产品分级设置,为不同份额投资者提供具有差异化收益和风险特征的投资工具。

业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:上证国债指数收益率\*95%+一年期定期存款利率\*5%

风险收益特征
本基金属于债券型基金,其预期风险和预期收益水平高于货币市场基金、债券型基金及货币市场基金。此外,本基金作为主动管理型基金,采用完全复制策略,跟踪标的指数的市场表现,目标为获取市场平均收益,是债券基金中处于中等风险水平的基金产品。

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

主要财务指标
报告期(2013年1月1日至2013年3月31日)
1.本期已实现收益:32,857,661.74
2.本期利润:17,313,195.76

3.加权平均基金份额本期利润:0.0489
4.期末基金资产净值:1,244,787,999.84
5.期末基金份额净值:1.0044

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,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

本基金本报告期末未持有股票、权证、股指期货、国债期货、股指期货、权证、股指期货、国债期货。

本基金本报告期末未持有资产支持证券。
本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规和公司内部制度,制定了《公平交易管理办法》,制定交易管理制度,对公平交易管理的各类资产的公平对待作了明确具体的规定,并规定对买卖股票、债券时价格和市场价格差较大,可能存在操纵股价、利益输送等违法违规情况进行监控。本报告期,按照时间优先、价格优先的原则,本公司对满足限价条件且同一证券有相同交易需求的基金等投资组合,均采用交易系统集中交易策略进行交易,实现了公平交易,未出现清算不到位的情况,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关联交易及交叉交易。

4.3 异常交易行为的专项说明
本基金本报告期未发现异常交易的情况。本报告期内,本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价时间反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的5%。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
本基金本报告期在保持资产流动性、PMI持续维持在50以上,发电量、工业增加值等温和回升,工业企业利润回升至15%以上,虽然1、2月份CPI略超预期,但3月份已大幅回落至2.1%,显示上半年通胀压力有所减轻,央行在一月份推出SLF操作,1月外汇占款持续大幅回落,货币市场流动性充裕,利率整体呈现下行态势。

在通胀低于预期和资金面宽松的推动下,一季度债券市场收益率下降明显,特别是信用债下跌幅度更大,随着股票市场转暖,转债市场出现回升态势,组合带来较好正收益。年初配置了较高比例的周期性品种,但3月份由于担心通胀高企,减持了大部分金融债,错过了收益率大幅下降的后半行情,一季度同时增持了较高的转债品种,分享了市场的上涨,特别是存在转债溢价转股价格后,转债溢价率大幅回落,投资价值得到大幅提升,3月底底债转债上市,民生转债成为市场热点,导致转债上市价格不高,溢价率偏低,转债投资收益低于民生转债的情况,组合减持了部分转债品种,民生转债。

4.2 报告期内基金的业绩表现
报告期内,工银瑞信A净值增长率为4.73%,工银瑞信B净值增长率为4.63%,业绩比较基准收益率为2.01%。

4.5 管理人对于宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
展望一季度,经济将保持弱复苏进程,复苏的核心力量来自于房地产投资,但近期的五条出台后对房地产投资影响较大,对于未来房地产投资的影响尚不确定,目前倾向于会有影响但不会持续较高的地产投资增速,从而对经济复苏提供支撑作用有限。CPI回落,一季度通胀仍将维持在较低水平,通胀压力不大,但全年来看,通胀仍将温和回升,在经济复苏、通胀压力不升反降下,货币政策一季度仍将维持中性,不会出现中性转宽松的情况。

4.6 报告期内基金投资组合的重大变动
本基金本报告期末持有的前十名股票为:中国平安、招商银行、浦发银行、民生银行、交通银行、中信银行、光大银行、华夏银行、兴业银行、浦发银行。本基金本报告期末持有的前十名债券为:1113001、1113002、1113003、1113004、1113005、1113006、1113007、1113008、1113009、1113010。

4.7 报告期内基金投资组合的重大变动
本基金本报告期末持有的前十名股票为:中国平安、招商银行、浦发银行、民生银行、交通银行、中信银行、光大银行、华夏银行、兴业银行、浦发银行。本基金本报告期末持有的前十名债券为:1113001、1113002、1113003、1113004、1113005、1113006、1113007、1113008、1113009、1113010。

4.8 报告期内基金投资组合的重大变动
本基金本报告期末持有的前十名股票为:中国平安、招商银行、浦发银行、民生银行、交通银行、中信银行、光大银行、华夏银行、兴业银行、浦发银行。本基金本报告期末持有的前十名债券为:1113001、1113002、1113003、1113004、1113005、1113006、1113007、1113008、1113009、1113010。

4.9 报告期内基金投资组合的重大变动
本基金本报告期末持有的前十名股票为:中国平安、招商银行、浦发银行、民生银行、交通银行、中信银行、光大银行、华夏银行、兴业银行、浦发银行。本基金本报告期末持有的前十名债券为:1113001、1113002、1113003、1113004、1113005、1113006、1113007、1113008、1113009、1113010。

4.10 报告期内基金投资组合的重大变动
本基金本报告期末持有的前十名股票为:中国平安、招商银行、浦发银行、民生银行、交通银行、中信银行、光大银行、华夏银行、兴业银行、浦发银行。本基金本报告期末持有的前十名债券为:1113001、1113002、1113003、1113004、1113005、1113006、1113007、1113008、1113009、1113010。

4.11 报告期内基金投资组合的重大变动
本基金本报告期末持有的前十名股票为:中国平安、招商银行、浦发银行、民生银行、交通银行、中信银行、光大银行、华夏银行、兴业银行、浦发银行。本基金本报告期末持有的前十名债券为:1113001、1113002、1113003、1113004、1113005、1113006、1113007、1113008、1113009、1113010。

4.12 报告期内基金投资组合的重大变动
本基金本报告期末持有的前十名股票为:中国平安、招商银行、浦发银行、民生银行、交通银行、中信银行、光大银行、华夏银行、兴业银行、浦发银行。本基金本报告期末持有的前十名债券为:1113001、1113002、1113003、1113004、1113005、1113006、1113007、1113008、1113009、1113010。

4.13 报告期内基金投资组合的重大变动
本基金本报告期末持有的前十名股票为:中国平安、招商银行、浦发银行、民生银行、交通银行、中信银行、光大银行、华夏银行、兴业银行、浦发银行。本基金本报告期末持有的前十名债券为:1113001、1113002、1113003、1113004、1113005、1113006、1113007、1113008、1113009、1113010。

4.14 报告期内基金投资组合的重大变动
本基金本报告期末持有的前十名股票为:中国平安、招商银行、浦发银行、民生银行、交通银行、中信银行、光大银行、华夏银行、兴业银行、浦发银行。本基金本报告期末持有的前十名债券为:1113001、1113002、1113003、1113004、1113005、1113006、1113007、1113008、1113009、1113010。

4.15 报告期内基金投资组合的重大变动
本基金本报告期末持有的前十名股票为:中国平安、招商银行、浦发银行、民生银行、交通银行、中信银行、光大银行、华夏银行、兴业银行、浦发银行。本基金本报告期末持有的前十名债券为:1113001、1113002、1113003、1113004、1113005、1113006、1113007、1113008、1113009、1113010。

4.16 报告期内基金投资组合的重大变动
本基金本报告期末持有的前十名股票为:中国平安、招商银行、浦发银行、民生银行、交通银行、中信银行、光大银行、华夏银行、兴业银行、浦发银行。本基金本报告期末持有的前十名债券为:1113001、1113002、1113003、1113004、1113005、1113006、1113007、1113008、1113009、1113010。

4.17 报告期内基金投资组合的重大变动
本基金本报告期末持有的前十名股票为:中国平安、招商银行、浦发银行、民生银行、交通银行、中信银行、光大银行、华夏银行、兴业银行、浦发银行。本基金本报告期末持有的前十名债券为:1113001、1113002、1113003、1113004、1113005、1113006、1113007、1113008、1113009、1113010。

4.18 报告期内基金投资组合的重大变动
本基金本报告期末持有的前十名股票为:中国平安、招商银行、浦发银行、民生银行、交通银行、中信银行、光大银行、华夏银行、兴业银行、浦发银行。本基金本报告期末持有的前十名债券为:1113001、1113002、1113003、1113004、1113005、1113006、1113007、1113008、1113009、1113010。

4.19 报告期内基金投资组合的重大变动
本基金本报告期末持有的前十名股票为:中国平安、招商银行、浦发银行、民生银行、交通银行、中信银行、光大银行、华夏银行、兴业银行、浦发银行。本基金本报告期末持有的前十名债券为:1113001、1113002、1113003、1113004、1113005、1113006、1113007、1113008、1113009、1113010。

4.20 报告期内基金投资组合的重大变动
本基金本报告期末持有的前十名股票为:中国平安、招商银行、浦发银行、民生银行、交通银行、中信银行、光大银行、华夏银行、兴业银行、浦发银行。本基金本报告期末持有的前十名债券为:1113001、1113002、1113003、1113004、1113005、1113006、1113007、1113008、1113009、1113010。

4.21 报告期内基金投资组合的重大变动
本基金本报告期末持有的前十名股票为:中国平安、招商银行、浦发银行、民生银行、交通银行、中信银行、光大银行、华夏银行、兴业银行、浦发银行。本基金本报告期末持有的前十名债券为:1113001、1113002、1113003、1113004、1113005、1113006、1113007、1113008、1113009、1113010。

4.22 报告期内基金投资组合的重大变动
本基金本报告期末持有的前十名股票为:中国平安、招商银行、浦发银行、民生银行、交通银行、中信银行、光大银行、华夏银行、兴业银行、浦发银行。本基金本报告期末持有的前十名债券为:1113001、1113002、1113003、1113004、1113005、1113006、1113007、1113008、1113009、1113010。

4.23 报告期内基金投资组合的重大变动
本基金本报告期末持有的前十名股票为:中国平安、招商银行、浦发银行、民生银行、交通银行、中信银行、光大银行、华夏银行、兴业银行、浦发银行。本基金本报告期末持有的前十名债券为:1113001、1113002、1113003、1113004、1113005、1113006、1113007、1113008、1113009、1113010。

4.24 报告期内基金投资组合的重大变动
本基金本报告期末持有的前十名股票为:中国平安、招商银行、浦发银行、民生银行、交通银行、中信银行、光大银行、华夏银行、兴业银行、浦发银行。本基金本报告期末持有的前十名债券为:1113001、1113002、1113003、1113004、1113005、1113006、1113007、1113008、1113009、1113010。

4.25 报告期内基金投资组合的重大变动
本基金本报告期末持有的前十名股票为:中国平安、招商银行、浦发银行、民生银行、交通银行、中信银行、光大银行、华夏银行、兴业银行、浦发银行。本基金本报告期末持有的前十名债券为:1113001、1113002、1113003、1113004、1113005、1113006、1113007、1113008、1113009、1113010。

4.26 报告期内基金投资组合的重大变动
本基金本报告期末持有的前十名股票为:中国平安、招商银行、浦发银行、民生银行、交通银行、中信银行、光大银行、华夏银行、兴业银行、浦发银行。本基金本报告期末持有的前十名债券为:1113001、1113002、1113003、1113004、1113005、1113006、1113007、1113008、1113009、1113010。

4.27 报告期内基金投资组合的重大变动
本基金本报告期末持有的前十名股票为:中国平安、招商银行、浦发银行、民生银行、交通银行、中信银行、光大银行、华夏银行、兴业银行、浦发银行。本基金本报告期末持有的前十名债券为:1113001、1113002、1113003、1113004、1113005、1113006、1113007、1113008、1113009、1113010。

4.28 报告期内基金投资组合的重大变动
本基金本报告期末持有的前十名股票为:中国平安、招商银行、浦发银行、民生银行、交通银行、中信银行、光大银行、华夏银行、兴业银行、浦发银行。本基金本报告期末持有的前十名债券为:1113001、1113002、1113003、1113004、1113005、1113006、1113007、1113008、1113009、1113010。

4.29 报告期内基金投资组合的重大变动
本基金本报告期末持有的前十名股票为:中国平安、招商银行、浦发银行、民生银行、交通银行、中信银行、光大银行、华夏银行、兴业银行、浦发银行。本基金本报告期末持有的前十名债券为:1113001、1113002、1113003、1113004、1113005、1113006、1113007、1113008、1113009、1113010。

4.30 报告期内基金投资组合的重大变动
本基金本报告期末持有的前十名股票为:中国平安、招商银行、浦发银行、民生银行、交通银行、中信银行、光大银行、华夏银行、兴业银行、浦发银行。本基金本报告期末持有的前十名债券为:1113001、1113002、1113003、1113004、1113005、1113006、1113007、1113008、1113009、1113010。

4.31 报告期内基金投资组合的重大变动
本基金本报告期末持有的前十名股票为:中国平安、招商银行、浦发银行、民生银行、交通银行、中信银行、光大银行、华夏银行、兴业银行、浦发银行。本基金本报告期末持有的前十名债券为:1113001、1113002、1113003、1113004、1113005、1113006、1113007、1113008、1113009、1113010。

4.32 报告期内基金投资组合的重大变动
本基金本报告期末持有的前十名股票为:中国平安、招商银行、浦发银行、民生银行、交通银行、中信银行、光大银行、华夏银行、兴业银行、浦发银行。本基金本报告期末持有的前十名债券为:1113001、1113002、1113003、1113004、1113005、1113006、1113007、1113008、1113009、1113010。

4.33 报告期内基金投资组合的重大变动
本基金本报告期末持有的前十名股票为:中国平安、招商银行、浦发银行、民生银行、交通银行、中信银行、光大银行、华夏银行、兴业银行、浦发银行。本基金本报告期末持有的前十名债券为:1113001、1113002、1113003、1113004、1113005、1113006、1113007、1113008、1113009、1113010。

工银瑞信双利债券型证券投资基金

2013 第一季度报告

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:二〇一三年四月二十二日

重要提示
基金管理人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。

基金管理人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年4月18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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。投资者在作出投资决策前请仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期末基金资产净值:1,244,787,999.84元
本报告期末基金份额总额:1,244,787,999.84份

投资目标
本基金采取主动投资策略,通过控制基金投资组合相对于标的指数的偏离度,实现对标的指数的有效跟踪,通过产品分级设置,为不同份额投资者提供具有差异化收益和风险特征的投资工具。

业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:上证