工银瑞信60天理财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:兴业银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一三年四月二十二日

§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。

基金托管人兴业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。

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2013年1月28日(基金合同生效日)起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	工银60天理财债券	
交易代码	485122	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年1月28日	
报告期末基金份额总额	2,483,659,253.24份	
投资目标	在控制风险并保持资产流动性的基础上,力争实现超过业绩比较基准的投资收益。	
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	人民币七天通知存款税后利率	
风险收益特征	本基金为债券型基金,预期收益和风险水平低于混合型基金、股票型基金,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	兴业银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	工银60天理财债券A	工银60天理财债券B
下属两级基金的交易代码	485122	485022
报告期末下属两级基金的份额总额	2,237,932,167.81份	245,727,085.43份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2013年1月28日 - 2013年3月31日)	
	工银60天理财债券A	工银60天理财债券B
1. 本期已实现收益	61,413,284.46	17,777,474.07
2.本期利润	61,413,284.46	17,777,474.07
3.期末基金资产净值	2,237,932,167.81	245,727,085.43

注:1)本基金收益分配是按日结转份额。
2)所列数据截止到2013年3月31日。
3)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所列数字。
4)本期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,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。
5)本基金基金合同生效日为2013年1月28日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

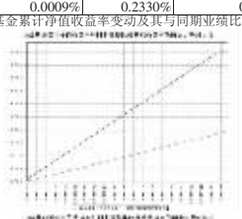
工银60天理财债券A

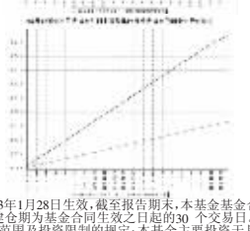
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.6137%	0.0012%	0.2330%	0.0000%	0.3807%	0.0012%

工银60天理财债券B

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	(1)-③	②-④
过去三个月	0.6660%	0.0009%	0.2330%	0.0000%	0.4330%	0.0009%

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





注:1、本基金基金合同于2013年1月28日生效,截至报告期末,本基金基金合同生效不满一年。
2、按基金合同规定,本基金建仓期为基金合同生效之日起的30个交易日。截至报告期末,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:本基金主要投资于具有良好流动性的工具,包括现金、通知存款、一年以内(含一年)的银行定期存款和大额存单、剩余期限(或回售期限)在397天以内(含397天)的债券、资产支持证券、中期票据;期限在一年以内(含一年)的债券回购、期限在一年以内(含一年)的中央银行票据、短期融资券,及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他固定收益类金融工具;本基金不直接在二级市场上买入股票、权证等权益类资产,也不参与一级市场新股申购和新股增发。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
宋炳珅	研究部总监,本基金基金经理	2013年1月28日	-	9	曾任中信建投证券有限公司研究员;2007年加入工银瑞信,现任研究部总监。2012年2月14日至今,担任工银瑞信添颐债券型证券投资基金基金经理;2013年1月18日至今,担任工银双利债券基金基金经理;2013年1月28日至今,担任工银瑞信60天理财债券型基金基金经理。
谷衡	本基金基金经理	2013年1月28日	-	8	先后在华夏银行总行担任交易员,在中信银行总行担任交易员;2012年加入工银瑞信,现任固定收益部基金经理;2012年11月13日起至今担任工银瑞信14天理财债券型发起式证券投资基金;2013年1月28日至今,担任工银瑞信60天理财债券型基金基金经理;2013年3月28日至今,担任工银安心场内实时申赎货币基金基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定,依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

为了公平对待各类投资人,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》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规和公司内部规章,拟定了《公平交易管理办法》、《异常交易管理办法》,对公司管理的各类资产的公平对待做了明确具体的规定,并规定对买卖股票、债券时候的价格和市场价格差距较大,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对同一证券有相同交易需求的基金等投资组合,均采用了系统中的公平交易模块进行操作,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反向交易及交叉交易。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内未出现异常交易的情况。本报告期内,本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日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

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

一季度经济总体延续前期温和复苏态势,但复苏力度弱于预期。通胀出现反复:先是2月CPI受春节因素影响上升至3.2%;而在食品价格大幅回落的影响下,3月CPI又大幅回落至2.1%。

货币政策维持中性,央行公开市场操作由逆回购转向正回购,但由于回购量维持低位,对资金面影响并不显著。

由于外汇占款的超预期流入等原因,市场资金面极为宽松,货币市场利率维持低位,春节、季末等因素均未对市场资金面形成较大冲击。债券方面,资金面的宽松,加上供求的不平衡,短融收益率一路下行。仅在3月初,由于担心资金面季节性走高,以及两会后经济复苏加快和通胀的趋势上行,债券市场收益率出现了短暂的调整。至季末,AAA和AA级别短融收益率分别至4%和4.32%,较年初下行45bp和53bp。

一季度,本基金主要通过对客户需求和货币市场的判断、合理安排组合内生现金流的方式来平衡组合流动性与收益,进行适当的期限管理。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内,工银60天理财A净值收益率0.6137%,工银60天理财B净值收益率0.6660%,业绩比较基准收益率为0.2330%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望二季度,经济增长的动能似乎并未进一步提高,而继房地产调控政策之后,影子银行监管的加强可能使资金供给的增速提前放缓,未来经济仍将维持稳定。物价水平仍将维持温和水平,CPI同比将维持在3%以内。货币政策将继续保持稳健,预计主要通过公开市场操作调节市场流动性。

在债券方面,短期内,银监会对"非标"理财的限制有利于债券市场,而PMI数据弱于季节性也使得市场对经济走势略显悲观,3月cpi的大幅下行也降低了未来通胀的预期,债券收益率将出现一定幅度的下行。但由于财政存款上缴等季节性原因,市场资金面临一定收紧压力,债市收益率下行幅度有限。存款方面,由于资金面的收紧预期,预计配置机会好于一季度,但需要把握好货币市场资金利率波动的节奏。

二季度,工银60天理财基金将继续保持稳健的投资思路,资产配置以存款、短期融资券等品种为主,严格控制低评级信用产品和中长期Shibor浮息债持仓比例以规避基金面临的信用风险和利率风险;同时我们继续将重点做好组合内生现金流的安排,在保证组合流动性的基础上获取较好的静态收益水平。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	912,054,689.09	33.17
	其中:债券	912,054,689.09	33.17
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	1,818,691,438.39	66.14
4	其他资产	18,894,283.13	0.69
5	合计	2,749,640,410.61	100.00

注:由于四舍五入的原因金额占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	0.54	
	其中:买断式回购融资	0.00	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	259,099,550.45	10.43
	其中:买断式回购融资	-	-

注:报告期内债券融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产余额比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的40%的说明

本报告期内本基金债券正回购的资金余额未超过基金资产净值的40%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	136
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	138
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	15

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

本报告期内无投资组合平均剩余期限超过180天情况。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	0.75	10.43
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	52.34	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	22.15	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-180天	8.88	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	25.83	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	109.95	10.43

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	900,726.93	0.04
5	企业短期融资券	911,153,962.16	36.69
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	912,054,689.09	36.72
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

注:上表中,债券的成本包括债券面值和折溢价。

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	041251022	12中建CP001	1,000,000	100,388,640.89	4.04
2	041359012	13沙钢CP001	900,000	89,918,457.07	3.62
3	041261041	12国电集CP004	500,000	50,297,099.74	2.03
4	041354006	13宁熊猫CP001	500,000	50,109,076.82	2.02
5	011332001	13华侨城SCP001	500,000	50,017,688.31	2.01
6	041364006	13忠旺CP001	500,000	50,003,317.86	2.01
7	041357002	13中色CP001	500,000	50,001,386.95	2.01
8	011333004	13五矿SCP004	500,000	49,987,593.51	2.01
9	041353016	13恒逸CP001	500,000	49,954,887.89	2.01
10	041352005	13西王CP001	400,000	40,000,142.68	1.61

注:上表中,债券的成本包括债券面值和折溢价。

5.6 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	-
报告期内偏离度的最高值	0.0238%
报告期内偏离度的最低值	0.0000%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0016%

注:上表中"偏离情况"根据报告期内各工作日数据计算。

5.7 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资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 本基金采用固定份额净值,基金账面份额净值始终保持为人民币1.00元。 本基金估值采用摊余成本法,即估值对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内按实际利率法进行摊销,每日计提收益或损失。

5.8.2 本报告期内本基金未持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券。

5.8.3 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。

5.8.4 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	9,705,190.13
4	应收申购款	9,189,093.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	18,894,283.13

5.8.5 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	10,135,833,732.68
基金合同生效日(2013年1月28日)基金份额总额	2,720,451,402.84
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	330,819,094.20
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	8,228,720,659.07
本报告期期末基金份额总额	2,237,932,167.81

§7 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会批准工银瑞信60天理财债券型证券投资基金设立的文件;
2、《工银瑞信60天理财债券型证券投资基金基金合同》;
3、《工银瑞信60天理财债券型证券投资基金托管协议》;
4、基金管理人业务资格批件和营业执照;
5、基金托管人业务资格批件和营业执照;
6、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

8.2 存放地点

基金管理人或基金托管人住所。

8.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅。也可在支付工本费后,在合理时间内取得上述文件的复印件。

工银瑞信保本混合型证券投资基金

【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:中国光大银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一三年四月二十二日

§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。

基金托管人中国光大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。

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2013年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	工银保本混合
交易代码	487016
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年12月27日
报告期末基金份额总额	1,573,378,725.76份
投资目标	依照保证合同,通过运用恒定比例投资组合保险策略,控制本金损失的风险,并在基金本金安全的基础上实现基金资产的稳定增值。
投资策略	运用投资组合保险技术,按照恒定比例投资组合保险机制(CPPI)对债券和股票等资产的投资比例进行动态调整,实现投资组合保值增值。
业绩比较基准	税后三年期银行定期存款利率
风险收益特征	本基金为保本混合型基金产品,属证券投资基金中的低风险收益品种。
基金管理人	工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人	中国光大银行股份有限公司
基金保证人	中海信达担保有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2013年1月1日 - 2013年3月31日)
1.本期已实现收益	65,060,622.41
2.本期利润	52,877,938.24
3.加权平均基金份额本期利润	0.0320
4.期末基金资产净值	1,688,426,983.11
5.期末基金份额净值	1.073

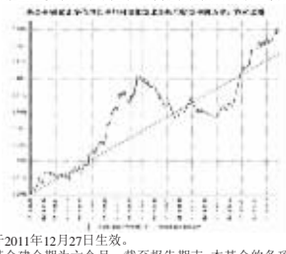
注:1)上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
2)本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额;本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
3)所列数据截止到2013年3月31日。

3.2 基金净值表现

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	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	3.07%	0.11%	1.23%	0.02%	1.84%	0.09%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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、本基金基金合同于2011年12月27日生效。
2、按基金合同规定,本基金建仓期为六个月。截至报告期末,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:本基金股票等风险资产占基金资产的比例不高于40%;债券、债券回购、银行存款等安全资产占基金资产的比例不低于60%;现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的5%。

3.3 其他指标

无。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
何秀红	本基金经理	2011年12月27日	-	6	曾任广发证券股份有限公司债券研究员;2009年加入工银瑞信,曾任固定收益研究员;2011年2月10日至今,担任工银四季收益债券型基金基金经理,2011年12月27日至今担任工银保本混合基金基金经理;2012年11月14日至今担任工银信用纯债债券基金基金经理;2013年3月29日至今,担任工银瑞信产业债债券基金基金经理。
欧阳凯	固定收益部副总监,本基金的基金经理。	2011年12月27日	-	11	曾任中海基金管理有限公司基金经理;2010年加入工银瑞信,现任固定收益部副总监。2010年8月16日至今,担任工银双利债券型基金基金经理,2011年12月27日至今担任工银保本混合基金基金经理;2013年2月7日至今担任工银瑞信保本2号混合型基金基金经理。
王勇	本基金基金经理	2011年12月27日	-	6	先后在慧聪国际咨询有限公司担任销售主管,香港新世界数字多媒体公司担任市场经理;2007年加入工银瑞信,曾任研究员兼专户投资顾问,2011年11月7日至今担任工银消费服务行业基金的基金经理,2011年12月27日至今担任工银保本混合基金基金经理;2013年2月7日至今担任工银瑞信保本2号混合型基金基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定,依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

为了公平对待各类投资人,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》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规和公司内部规章,拟定了《公平交易管理办法》、《异常交易管理办法》,对公司管理的各类资产的公平对待做了明确具体的规定,并规定对买卖股票、债券时候的价格和市场价格差距较大,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对同一证券有相同交易需求的基金等投资组合,均采用了系统中的公平交易模块进行操作,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反向交易及交叉交易。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内未出现异常交易的情况。本报告期内,本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日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

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2013年一季度,中国国内货币政策从宽松转为中性,春节后,央行重新启动28天和91天正回购。一季度宏观经济数据普遍低于预期,市场对于经济的预期从乐观转为中性。

在货币宽松的格局下,一季度债券市场总体上涨,利率、信用产品均有所上涨,低等级信用产品涨幅相对更大。

股票市场在春节后明显调整,银行、地产为代表的低估值股票的下跌幅度较大,消费、电子等高估值成长股上涨幅度较大。

工银保本在一季度面临了一定赎回,减持了AAA级别信用债和政策性金融债。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金净值增长率为3.07%,业绩比较基准收益率为1.23%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2013年二季度,中国经济将继续弱复苏格局。但复苏程度有向下的风险。由于央行重新启动正回购,银行间资金有收紧的风险。

对于房地产的调控措施,从单纯限购、税收等手段无法对于房地产价格形成压制,而降低货币增速,将从根本上对社会资产价格形成压制。

在规范影子银行和地方农信社对于信托的资金支持的背景下,固定资产投资将受到压制,对于债券市场形成支撑,对于股票市场有一定压制作用。

本基金在2013年将继续关注宏观经济的走向,持有高等级信用产品,对于新股,本基金将采取稳健报价的策略。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	49,828,447.65	2.91
	其中:股票	49,828,447.65	2.91
2	固定收益投资	1,555,597,097.00	90.84
	其中:债券	1,555,597,097.00	90.84
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	90,147,766.13	5.26
6	其他资产	16,946,005.20	0.99
7	合计	1,712,519,315.98	100.00

注:由于四舍五入的原因金额占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	47,999,914.68	2.84
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,828,532.97	0.11
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	49,828,447.65	2.95

注: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。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000639	西王食品	696,777	12,869,471.19	0.76
2	600887	伊利股份	300,000	9,504,000.00	0.56
3	300043	星辉车模	400,000	7,708,000.00	0.46
4	600066	宇通客车	220,000	6,294,200.00	0.37
5	601311	骆驼股份	400,000	4,936,000.00	0.29
6	002311	海大集团	249,459	4,268,243.49	0.25
7	600196	复星医药	200,000	2,420,000.00	0.14
8	300315	掌趣科技	49,919	1,828,532.97	0.11

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	100,230,000.00	5.94
2	央行票据	-	-
3	金融债券	50,175,000.00	2.97
	其中:政策性金融债	50,175,000.00	2.97
4	企业债券	1,084,439,945.00	64.23
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	314,201,000.00	18.61
7	可转债	6,551,152.00	0.39
8	其他	-	-
9	合计	1,555,597,097.00	92.13

注: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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	126016	08宝钢债	3,366,030	323,677,444.80	19.17
2	126008	08上汽债	1,600,000	156,480,000.00	9.27
3	1182279	11宛矿MTN2	1,500,000	152,325,000.00	9.02
4	122128	11武钢债	1,113,760	111,710,128.00	6.62
5	126010	08中远债	1,050,000	102,165,000.00	6.05

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资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末投资股指期货。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 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。

5.9.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	423,651.60
2	应收证券清算款	112.56
3	应收股利	-
4	应收利息	16,447,459.42
5	应收申购款	74,781.62
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	16,946,005.20

5.9.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.9.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限情况。

5.9.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	1,738,635,370.50
本报告期基金总申购份额	5,019,185.31
减:本报告期基金总赎回份额	170,275,830.05
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,573,378,725.76

§7 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会批准工银瑞信保本混合型证券投资基金设立的文件;
2、《工银瑞信保本混合型证券投资基金基金合同》;
3、《工银瑞信保本混合型证券投资基金托管协议》;
4、基金管理人业务资格批件和营业执照;
5、基金托管人业务资格批件和营业执照;
6、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

8.2 存放地点

基金管理人或基金托管人住所。

8.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅。也可在支付工本费后,在合理时间内取得上述文件的复印件。

工银瑞信7天理财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:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一三年四月二十二日

§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。

基金托管人中国建设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。

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2013年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	工银7天理财债券	
交易代码	485118	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012年8月22日	
报告期末基金份额总额	30,631,034,271.24份	
投资目标	在控制风险并保持资产流动性的基础上,力争实现超过业绩比较基准的投资收益。	
投资策略	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	人民币七天通知存款税后利率。	
风险收益特征	本基金为债券型基金,预期收益和风险水平低于混合型基金、股票型基金,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	中国建设银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	工银7天理财债券A	工银7天理财债券B
下属两级基金的交易代码	485118	485018
报告期末下属两级基金的份额总额	22,037,857,600.79份	8,593,176,670.45份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2013年1月1日 - 2013年3月31日)	
	工银7天理财债券A	工银7天理财债券B
1. 本期已实现收益	237,174,799.61	102,670,515.63
2.本期利润	237,174,799.61	102,670,515.63
3.期末基金资产净值	22,037,857,600.79	8,593,176,670.45

注:1)本基金收益分配是按日结转份额。
2)所列数据截止到2013年3月31日。
3)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所列数字。
4)本期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,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。
5)本基金基金合同生效日为2012年8月22日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

工银7天理财债券A

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.9869%	0.0012%	0.3329%	0.0000%	0.6540%	0.0012%

工银7天理财债券B

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	(1)-③	②-④
过去三个月	1.0591%