

工银瑞信双债增强债券型证券投资基金

[2013] 第四季度报告

基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一四年一月二十二日

5.1 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。
本公司及本公司股东承诺将遵守《证券投资基金法》等有关法律法规和基金合同的规定，于2014年1月17日恢复本报告书的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复牌后不存在虚假记载、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。投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书、基金合同。

本报告期财务数据未经审计。

本报告期自2013年10月1日起至2013年12月31日止。

5.2 基金产品概况

基金简称	工银双债增强债券(场内简称:工银双债)
交易代码	164814
基金份额上市方式	上市契约型开放式(LOF)
基金合同生效日	2013年9月25日
报告期末基金份额总额	412,116,928.75份

投资目标 在锁定投资组合下方风险的基础上，通过积极主动的可转债、信用投资管理，追求基金资产的长期稳定增值。

本基金将在资产配置策略的基础上，通过构建债券组合以获取相对稳定的收益基础，同时通过重仓投资可转债和信用债以及适当把握权益类资产的投资机会来提高基金资产的收益水平。

业绩比较基准 本基金的业绩比较基准为：天相可转债指数收益率×40%+中债企业债指数收益率×60%

风险收益特征 本基金为债券基金，预期收益和风险水平低于股票基金。另外，由于本基金可转债（在二级交易市场的转换债券）和信用债会计计提比例不低于固定收益类资产的30%，而可转债和信用债的预期收益率和风险水平通常高于普通债券，因此，本基金的预期收益和风险水平通常高于普通债券型基金，但低于股票型基金等评级价值体系。

基金管理人 工银瑞信基金管理有限公司

基金托管人 中国银行股份有限公司

5.3 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10月1日-2013年12月31日)
1.本期已实现收益	4,170,179.53
2.本期利润	1,957,431.92
3.加权平均基金份额本期利润	0.0047
4.期末基金份额净值	414,301,900.59
5.期末基金份额净值	1.005

(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上述数字。

(2) 所列数据截至2013年12月31日。

(3) 本基金合同生效日为2013年9月25日。

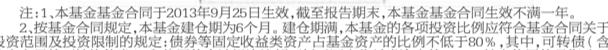
(4) 本基金未按期向基金份额持有人支付收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本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

阶段	净值增长率 (①) 标准差(②)	业绩比较基 准收益率(③) 标准差(④)	①-③	②-④
过去三个月	0.4000%	0.0700%	-3.5600%	0.2000%

3.2.2 本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. 本基金合同成立于2013年9月25日, 故截至报告期末, 本基金基金合同尚未满一年。

2. 根据基金合同规定, 本基金建仓期为6个月。建仓期间, 本基金的各项投资比例均符合基金合同关于投资范围及投资限制的规定; 本基金的累计净值增长率在建仓期结束时不低于95%; 其他投资(可转债(含分离交易的可转债)、股票、权证、基金等金融工具)的投资比例不超过基金资产的30%; 股票、权证等权益类资产占基金资产的比例不超过20%。

3.3 其他指标

5.4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任职日期	说明
王伟	本基金的基金经理	2013年9月25日	注:王伟, 计算机专业, 在任于华泰证券公司信息技术部, Tricor公司, 2007年1月至2010年1月在工银瑞信基金管理有限公司担任基金经理, 2012年11月至今任本基金基金经理, 直接负责本基金的投资管理工作。2013年9月25日至今任本基金基金经理。

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, 本公司及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, 招募说明书等基金法律文件的规定, 依法规范运作, 勤勉尽责地履行运用基金资产, 在控制风险的基础上, 为基金份额持有人谋取最大利益, 无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易制度执行的说明

为了公平对待各类投资人, 保护各类型投资人利益, 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》、《证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构内部控制指导意见》等法律法规及基金合同, 对证券投资基金的公平交易制度、公平交易执行情况、公平交易监控和报告、公平交易披露等方面进行了明确规定。

4.4 报告期内本基金的定期报告、临时报告和公告的披露情况

4.4.1 本报告期内, 本公司所有投资组合参与的交易所公开

4.4.2 本报告期内, 国内债券市场因保持平稳而边际小幅走弱, 外币货币政策目标着重于防风

险和结构调整, 期间通过对暂停申购操作的市场传递密切关注态度, 资金成本持续处于较高水平, 在

在偏紧的实体经济环境下没有出现明显回落。

债券市场价格一路上扬明显超出此前市场预期和宏观数据所隐含的水平, 原因包括经济增长中

对利率不敏感的地方融资平台和房地产投资比重过高, 投资者配置向高收益资产转移, 利率市场化推进

注:1. 本基金报告期自2013年9月25日生效, 截至报告期末, 本基金基金合同尚未满一年。

2. 根据基金合同规定, 本基金建仓期为6个月。建仓期间, 本基金的各项投资比例均符合基金合同关于投资范围及投资限制的规定; 本基金的累计净值增长率在建仓期结束时不低于95%; 其他投资(可转债(含分离交易的可转债)、股票、权证、基金等金融工具)的投资比例不超过基金资产的30%; 股票、权证等权益类资产占基金资产的比例不超过20%。

3.3 其他指标

5.4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任职日期	说明
王伟	本基金的基金经理	2013年9月25日	注:王伟, 计算机专业, 在任于华泰证券公司信息技术部, Tricor公司, 2007年1月至2010年1月在工银瑞信基金管理有限公司担任基金经理, 2012年11月至今任本基金基金经理, 直接负责本基金的投资管理工作。2013年9月25日至今任本基金基金经理。

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, 本公司及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, 招募说明书等基金法律文件的规定, 依法规范运作, 勤勉尽责地履行运用基金资产, 在控制风险的基础

上, 为基金份额持有人谋取最大利益, 无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易制度执行的说明

为了公平对待各类投资人, 保护各类型投资人利益, 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》、《证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构内部控制指导意见》等法律法规及基金合同, 对证券投资基金的公平交易制度、公平交易执行情况、公平交易监控和报告、公平交易披露等方面进行了明确规定。

4.4 报告期内本基金的定期报告、临时报告和公告的披露情况

4.4.1 本报告期内, 本公司所有投资组合参与的交易所公开

4.4.2 本报告期内, 国内债券市场因保持平稳而边际小幅走弱, 外币货币政策目标着重于防风

险和结构调整, 期间通过对暂停申购操作的市场传递密切关注态度, 资金成本持续处于较高水

平, 在偏紧的实体经济环境下没有出现明显回落。

债券市场价格一路上扬明显超出此前市场预期和宏观数据所隐含的水平, 原因包括经济增

长对利率不敏感的地方融资平台和房地产投资比重过高, 投资者配置向高收益资产转移, 利率

市场化推进

注:1. 本基金已实现收益指收入, 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, 为2013年1月1日至2013年12月31日。

2. 本基金合同生效日为2013年9月25日。

3.3 其他指标

5.4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任职日期	说明
王伟	本基金的基金经理	2013年9月25日	注:王伟, 计算机专业, 在任于华泰证券公司信息技术部, Tricor公司, 2007年1月至2010年1月在工银瑞信基金管理有限公司担任基金经理, 2012年11月至今任本基金基金经理, 直接负责本基金的投资管理工作。2013年9月25日至今任本基金基金经理。

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, 本公司及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, 招募说明书等基金法律文件的规定, 依法规范运作, 勤勉尽责地履行运用基金资产, 在控制风险的基础

上, 为基金份额持有人谋取最大利益, 无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易制度执行的说明

为了公平对待各类投资人, 保护各类型投资人利益, 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》、《证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构内部控制指导意见》等法律法规及基金合同, 对证券投资基金的公平交易制度、公平交易执行情况、公平交易监控和报告、公平交易披露等方面进行了明确规定。

4.4 报告期内本基金的定期报告、临时报告和公告的披露情况

4.4.1 本报告期内, 本公司所有投资组合参与的交易所公开

4.4.2 本报告期内, 国内债券市场因保持平稳而边际小幅走弱, 外币货币政策目标着重于防风

险和结构调整, 期间通过对暂停申购操作的市场传递密切关注态度, 资金成本持续处于较高水

平, 在偏紧的实体经济环境下没有出现明显回落。

债券市场价格一路上扬明显超出此前市场预期和宏观数据所隐含的水平, 原因包括经济增

长对利率不敏感的地方融资平台和房地产投资比重过高, 投资者配置向高收益资产转移, 利率

市场化推进

注:1. 本基金已实现收益指收入, 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, 为2013年1月1日至2013年12月31日。

2. 本基金合同生效日为2013年9月25日。

3.3 其他指标

5.4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任职日期	说明
王伟	本基金的基金经理	2013年9月25日	注:王伟, 计算机专业, 在任于华泰证券公司信息技术部, Tricor公司, 2007年1月至2010年1月在工银瑞信基金管理有限公司担任基金经理, 2012年11月至今任本基金基金经理, 直接负责本基金的投资管理工作。2013年9月25日至今任本基金基金经理。

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, 本公司及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, 招募说明书等基金法律文件的规定, 依法