

## 工银瑞信大盘蓝筹股票型证券投资基金

[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

## § 1 重要提示

基金管理人的董事、监事、高级管理人员在报告期内未发生重大变化,并对具体内容的真实性、准确性、完整性承担责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年1月17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。

基金投资者欲了解详细情况,请仔细阅读本基金的招募说明书。

本基金不接受个人投资者开户。

本报告期自2013年10月1日起至2013年12月31日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称:工银瑞信大盘蓝筹股票

基金代码:481008

报告期末基金份额总额:368,403,001.00

报告期末基金份额净值:1.00元

报告期末总资产:368,403,001.00

报告期末净资产:368,403,001.00

报告期末基金份额占比净值:1.00%

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。

5.2 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	4,908,026.64	1.34
B 采矿业	7,760,000.00	2.12
C 制造业	181,319,646.92	49.56
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,144,000.00	0.86
E 建筑业	11,718,309.36	3.20
F 批发和零售业	5,321,895.81	1.45
G 交通运输、仓储和邮政业	4,694,406.95	1.28
H 住宿和餐饮业	-	-
I 信息传输、软件和信息技术服务业	512,700.00	0.14
J 金融业	50,710,246.55	13.86
K 房地产业	18,640,183.37	5.09
L 租赁和商务服务业	-	-
M 科学研究和技术服务业	2,812,000.00	0.77
N 水利、环境和公共设施管理业	1,224,697.50	0.33
O 居民服务、修理和其他服务业	-	-
P 教育	-	-
Q 生产和社会工作	2,081,300.00	0.57
R 文化、体育和娱乐业	-	-
S 其他	-	-

5.3 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 15,697,268.95

2.本期利润 1,055,852.76

3.期初平均基金份额利润 0.0022

4.期末基金份额净值 365,875,491.79

5.期末基金份额净值 0.7799

注:(1)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)和除股息红利收益后的余额;

(2)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12月31日。

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的比较

阶段 净值增长率① 净值增长率差② 业绩比较基准收益率③ 收益率标准差④

①-③ ②-④

过去三个月 0.26% 1.04% -2.45% 0.90% 2.71% 0.14%

3.22 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的比较

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

3.23 其他指标

无。

## § 4 管理人报告

## 4.1 基金经理(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

胡文魁 本基金的基金经理 2013年3月16日 - 12 先后在国泰君安证券股份有限公司担任研究员,华林证券有限公司担任研究员,2006年加入工银瑞信基金管理有限公司,历任行业研究员、股票投资经理、股票投资总监,2010年1月10日-担任工银瑞信ETF基金经理;2010年5月10日-担任工银瑞信货币基金基金经理,2010年6月15日-担任工银瑞信货币基金基金经理,2011年1月10日至今日,担任工银瑞信货币基金基金经理,2012年11月10日至今日,担任工银瑞信大盘蓝筹股票型基金经理。

王群策 本基金的基金经理 2012年12月5日 - 16 2008年加入工银瑞信,曾任工银瑞信价值基金、工银瑞信均衡回报基金经理,工银瑞信成金回报基金经理,2010年1月10日-担任工银瑞信货币基金基金经理,2010年6月10日至今日,担任工银瑞信货币基金经理,2012年12月5日至今日,担任工银瑞信大盘蓝筹股票型基金经理。

4.2 管理人对报告期内基金运作遵规守信情况的说明

本公司内部,本公司员工严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同,认真履行说明书中有关基金法律文件约定的义务,勤勉尽责地履行职责,严格执行基金的投资决策和运用基金资产,在控制风险的基础上谋求最大利益,无损害基金额度持有人利益的行为。

4.3 公平交易制度的执行情况

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本公司对旗下所有投资组合每日进行公平交易监控,定期对不同投资组合间的收益率差异、交易时机选择和交易定价进行监控。本公司根据,按时间间隔、价格优先、金额优先的原则对同一证券有相同交易需求的多个投资组合,通过综合平衡各投资组合间交易时机选择和交易定价,实现公平交易。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本公司对旗下所有投资组合每日进行公平交易监控,定期对不同投资组合间的收益率差异、交易时机选择和交易定价进行监控。本公司根据,按时间间隔、价格优先、金额优先的原则对同一证券有相同交易需求的多个投资组合,通过综合平衡各投资组合间交易时机选择和交易定价,实现公平交易。

4.3.3 公平交易制度的执行情况

本公司对旗下所有投资组合每日进行公平交易监控,定期对不同投资组合间的收益率差异、交易时机选择和交易定价进行监控。本公司根据,按时间间隔、价格优先、金额优先的原则对同一证券有相同交易需求的多个投资组合,通过综合平衡各投资组合间交易时机选择和交易定价,实现公平交易。

4.3.4 公平交易制度的执行情况

本公司对旗下所有投资组合每日进行公平交易监控,定期对不同投资组合间的收益率差异、交易时机选择和交易定价进行监控。本公司根据,按时间间隔、价格优先、金额优先的原则对同一证券有相同交易需求的多个投资组合,通过综合平衡各投资组合间交易时机选择和交易定价,实现公平交易。

4.3.5 公平交易制度的执行情况

本公司对旗下所有投资组合每日进行公平交易监控,定期对不同投资组合间的收益率差异、交易时机选择和交易定价进行监控。本公司根据,按时间间隔、价格优先、金额优先的原则对同一证券有相同交易需求的多个投资组合,通过综合平衡各投资组合间交易时机选择和交易定价,实现公平交易。

4.3.6 公平交易制度的执行情况

本公司对旗下所有投资组合每日进行公平交易监控,定期对不同投资组合间的收益率差异、交易时机选择和交易定价进行监控。本公司根据,按时间间隔、价格优先、金额优先的原则对同一证券有相同交易需求的多个投资组合,通过综合平衡各投资组合间交易时机选择和交易定价,实现公平交易。

4.3.7 公平交易制度的执行情况

本公司对旗下所有投资组合每日进行公平交易监控,定期对不同投资组合间的收益率差异、交易时机选择和交易定价进行监控。本公司根据,按时间间隔、价格优先、金额优先的原则对同一证券有相同交易需求的多个投资组合,通过综合平衡各投资组合间交易时机选择和交易定价,实现公平交易。

4.3.8 公平交易制度的执行情况

本公司对旗下所有投资组合每日进行公平交易监控,定期对不同投资组合间的收益率差异、交易时机选择和交易定价进行监控。本公司根据,按时间间隔、价格优先、金额优先的原则对同一证券有相同交易需求的多个投资组合,通过综合平衡各投资组合间交易时机选择和交易定价,实现公平交易。

4.3.9 公平交易制度的执行情况

本公司对旗下所有投资组合每日进行公平交易监控,定期对不同投资组合间的收益率差异、交易时机选择和交易定价进行监控。本公司根据,按时间间隔、价格优先、金额优先的原则对同一证券有相同交易需求的多个投资组合,通过综合平衡各投资组合间交易时机选择和交易定价,实现公平交易。

4.3.10 公平交易制度的执行情况

本公司对旗下所有投资组合每日进行公平交易监控,定期对不同投资组合间的收益率差异、交易时机选择和交易定价进行监控。本公司根据,按时间间隔、价格优先、金额优先的原则对同一证券有相同交易需求的多个投资组合,通过综合平衡各投资组合间交易时机选择和交易定价,实现公平交易。

4.3.11 公平交易制度的执行情况

本公司对旗下所有投资组合每日进行公平交易监控,定期对不同投资组合间的收益率差异、交易时机选择和交易定价进行监控。本公司根据,按时间间隔、价格优先、金额优先的原则对同一证券有相同交易需求的多个投资组合,通过综合平衡各投资组合间交易时机选择和交易定价,实现公平交易。

4.3.12 公平交易制度的执行情况

本公司对旗下所有投资组合每日进行公平交易监控,定期对不同投资组合间的收益率差异、交易时机选择和交易定价进行监控。本公司根据,按时间间隔、价格优先、金额优先的原则对同一证券有相同交易需求的多个投资组合,通过综合平衡各投资组合间交易时机选择和交易定价,实现公平交易。

4.3.13 公平交易制度的执行情况

本公司对旗下所有投资组合每日进行公平交易监控,定期对不同投资组合间的收益率差异、交易时机选择和交易定价进行监控。本公司根据,按时间间隔、价格优先、金额优先的原则对同一证券有相同交易需求的多个投资组合,通过综合平衡各投资组合间交易时机选择和交易定价,实现公平交易。

4.3.14 公平交易制度的执行情况

本公司对旗下所有投资组合每日进行公平交易监控,定期对不同投资组合间的收益率差异、交易时机选择和交易定价进行监控。本公司根据,按时间间隔、价格优先、金额优先的原则对同一证券有相同交易需求的多个投资组合,通过综合平衡各投资组合间交易时机选择和交易定价,实现公平交易。

4.3.15 公平交易制度的执行情况

本公司对旗下所有投资组合每日进行公平交易监控,定期对不同投资组合间的收益率差异、交易时机选择和交易定价进行监控。本公司根据,按时间间隔、价格优先、金额优先的原则对同一证券有相同交易需求的多个投资组合,通过综合平衡各投资组合间交易时机选择和交易定价,实现公平交易。

4.3.16 公平交易制度的执行情况

本公司对旗下所有投资组合每日进行公平交易监控,定期对不同投资组合间的收益率差异、交易时机选择和交易定价进行监控。本公司根据,按时间间隔、价格优先、金额优先的原则对同一证券有相同交易需求的多个投资组合,通过综合平衡各投资组合间交易时机选择和交易定价,实现公平交易。

4.3.17 公平交易制度的执行情况

本公司对旗下所有投资组合每日进行公平交易监控,定期对不同投资组合间的收益率差异、交易时机选择和交易定价进行监控。本公司根据,按时间间隔、价格优先、金额优先的原则对同一证券有相同交易需求的多个投资组合,通过综合平衡各投资组合间交易时机选择和交易定价,实现公平交易。

4.3.18 公平交易制度的执行情况

本公司对旗下所有投资组合每日进行公平交易监控,定期对不同投资组合间的收益率差异、交易时机选择和交易定价进行监控。本公司根据,按时间间隔、价格优先、金额优先的原则对同一证券有相同交易需求的多个投资组合,通过综合平衡各投资组合间交易时机选择和交易定价,实现公平交易。

4.3.19 公平交易制度的执行情况

本公司对旗下所有投资组合每日进行公平交易监控,定期对不同投资组合间的收益率差异、交易时机选择和交易定价进行监控。本公司根据,按时间间隔、价格优先、金额优先的原则对同一证券有相同交易需求的多个投资组合,通过综合平衡各投资组合间交易时机选择和交易定价,实现公平交易。

4.3.20 公平交易制度的执行情况

本公司对旗下所有投资组合每日进行公平交易监控,定期对不同投资组合间的收益率差异、交易时机选择和交易定价进行监控。本公司根据,按时间间隔、价格优先、金额优先的原则对同一证券有相同交易需求的多个投资组合,通过综合平衡各投资组合间交易时机选择和交易定价,实现公平交易。

4.3.21 公平交易制度的执行情况

本公司对旗下所有投资组合每日进行公平交易监控,定期对不同投资组合间的收益率差异、交易时机选择和交易定价进行监控。本公司根据,按时间间隔、价格优先、金额优先的原则对同一证券有相同交易需求的多个投资组合,通过综合平衡各投资组合间交易时机选择和交易定价,实现公平交易。

4.3.22 公平交易制度的执行情况

本公司对旗下所有投资组合每日进行公平交易监控,定期对不同投资组合间的收益率差异、交易时机选择和交易定价进行监控。本公司根据,按时间间隔、价格优先、金额优先的原则对同一证券有相同交易需求的多个投资组合,通过综合平衡各投资组合间交易时机选择和交易定价,实现公平交易。

4.3.23 公平交易制度的执行情况

本公司对旗下所有投资组合每日进行公平交易监控,定期对不同投资组合间的收益率差异、交易时机选择和交易定价进行监控。本公司根据,按时间间隔、价格优先、金额优先的原则对同一证券有相同交易需求的多个投资组合,通过综合平衡各投资组合间交易时机选择和交易定价,实现公平交易。

4.3.24 公平交易制度的执行情况

本公司对旗下所有投资组合每日进行公平交易监控,定期对不同投资组合间的收益率差异、交易时机选择和交易定价进行监控。本公司根据,按时间间隔、价格优先、金额优先的原则对同一证券有相同交易需求的多个投资组合,通过综合平衡各投资组合间交易时机选择和交易定价,实现公平交易。

4.3.25 公平交易制度的执行情况

本公司对旗下所有投资组合每日进行公平交易监控,定期对不同投资组合间的收益率差异、交易时机选择和交易定价进行监控。本公司根据,按时间间隔、价格优先、金额优先的原则对同一证券有相同交易需求的多个投资组合,通过综合平衡各投资组合间交易时机选择和交易定价,实现公平交易。

4.3.26 公平交易制度的执行情况

本公司对旗下所有投资组合每日进行公平交易监控,定期对不同投资组合间的收益率差异、交易时机选择和交易定价进行监控。本公司根据,按时间间隔、价格优先、金额优先的原则对同一证券有相同交易需求的多个投资组合,通过综合平衡各投资组合间交易时机选择和交易定价,实现公平交易。

4.3.27 公平交易制度的执行情况

本公司对旗下所有投资组合每日进行公平交易监控,定期对不同投资组合间的收益率差异、交易时机选择和交易定价进行监控。本公司根据,按时间间隔、价格优先、金额优先的原则对同一证券有相同交易需求的多个投资组合,通过综合平衡各投资组合间交易时机选择和交易定价,实现公平交易。

4.3.2