

工银瑞信保本2号混合型发起式证券投资基金

[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:中国光大银行股份有限公司
报告送出日期:2014年1月21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。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2013年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称 工银保本2号混合发起

交易代码 487021

基金运作方式 约定开放式

基金合同生效日 2013年2月7日

报告期末基金份额总额 1,011,772,942.24份

投资目标 依循保本合同，通过运用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 本基金在资产配置策略上，采用恒定比例投资组合保险策略(Constant-Proportion Portfolio Insurance, CPPI)来实现保本和增值的双目标。

人民币在后三年定期存款利率。在本报告期开始当年，上述“三年定期存款利率”指基金合同生效当日中国人民银行公布的二年期“金融机构人民币存款基准利率”。其后的每年自然年，三年定期存款利率指基金合同生效当年中国人民银行公布并执行的三年期“金融机构人民币存款基准利率”。

业绩比较基准 本基金是一只保本混合型基金，属于基金中的低风险品种。

本基金是一只保本混合型基金，属于基金中的低风险品种。

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 中海信托担保有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

报告期(2013年10月1日-2013年12月31日) 单位:人民币元

1.本期已实现收益 10,853,500.04

2.本期利润 -22,465,224.83

3.期初平均基金份额利润 -0.0215

4.期末基金份额净值 994,70,452.27

5.期末基金份额净值 0.983

注: (1)上述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同类理财产品。

(2)本基金三年定期存款利率指基金合同生效当年中国人民银行公布的二年期“金融机构人民币存款基准利率”。其后的每年自然年,三年定期存款利率指基金合同生效当年中国人民银行公布并执行的三年期“金融机构人民币存款基准利率”。

6.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

7.报告期末基金份额总额 1,011,772,942.24份

8.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

9.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

10.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

11.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

12.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

13.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

14.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

15.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

16.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

17.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

18.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

19.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

20.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

21.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

22.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

23.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

24.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

25.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

26.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

27.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

28.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

29.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

30.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

31.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

32.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

33.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

34.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

35.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

36.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

37.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

38.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

39.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

40.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

41.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

42.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

43.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

44.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

45.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

46.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

47.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

48.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

49.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

50.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

51.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

52.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

53.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

54.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

55.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

56.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

57.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

58.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

59.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

60.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

61.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

62.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

63.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

64.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

65.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

66.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

67.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

68.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

69.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

70.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

71.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

72.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

73.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

74.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

75.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

76.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

77.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

78.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

79.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

80.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

81.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

82.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

83.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

84.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

85.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

86.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

87.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

88.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

89.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

90.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

91.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

92.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

93.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

94.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

95.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

96.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

97.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

98.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

99.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

100.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

101.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

102.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

103.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

104.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

105.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

106.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

107.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

108.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

109.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

110.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

111.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

112.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

113.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

114.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

115.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

116.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

117.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

118.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10

119.报告期基金份额净值 1,337,992,449.10