

# 工银瑞信保本混合型证券投资基金

## [2014]第三季度报告

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：二〇一四年十月二十七日

【重要提示】

基金管理人的管理费从基金财产中计提，具体描述或重大遗漏，并对其实内容的真准确性、准确性和完整性承

认和责任在任。

基金合同由基金管理人和基金托管人订立，于2014年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组

合报告等文件，确认其不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

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预示其未来表现。投资人投资有风险，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。

本报告期利润为2014年7月1日至9月30日止。

§ 2.基金产品概况

### 6.2 报告期末行业分类的股权投资组合

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		15,382,965.04	1.25
B 采矿业		-	-
C 制造业		21,490,599.73	1.74
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业		800,379.12	0.06
E 建筑业		-	-
F 批发业零售业		-	-
G 交通运输、仓储和邮政业		-	-
H 餐饮住宿业		-	-
I 信息传输、软件和信息技术服务业		1,494,598.08	0.12
J 金融业		-	-
K 房地产业		-	-
L 租赁和商务服务业		-	-
M 科学研究、技术服务及地质勘查业		-	-
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 合计		39,688,571.97	3.17

注：由于四舍五入的原因公允价值占基金资产净值的比例之和与合计可能有尾差。

6.3 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

代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1 002714	新钢股份	279,832	15,382,965.04	1.25
2 600092	金融街	560,000	11,048,800.00	0.89
3 02266	渤海租赁	800,000	5,888,000.00	0.48
4 300397	天房发展	23,534	2,473,686.74	0.20
5 300392	华昌化工	14,784	1,494,598.08	0.12
6 604356	九芝药业	72,240	1,114,663.20	0.09
7 601016	节能风电	195,364	670,167.12	0.05
8 300402	宝德股份	79,628	355,937.16	0.03
9 300398	万孚材料	18,744	340,203.60	0.03
10 600310	万邦股份	14,119	165,192.30	0.01

注：(1)上述基金的收益扣除费用后低于零时以零计算；(2)买入即刻收益；(3)卖出即刻亏损；(4)买入即刻盈亏；(5)卖出即刻盈亏。

6.4 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债券投资明细

6.5 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贵金属投资明细

6.6 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期权投资明细

6.7 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权证投资明细

6.8 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指期货投资明细

6.9 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国债期货投资明细

6.10 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货币市场基金投资明细

6.11 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定期存款投资明细

6.12 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存出保证金投资明细

6.13 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其他投资明细

6.14 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资产支持证券投资明细

6.15 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买入返售金融资产投资明细

6.16 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应收款项投资明细

6.17 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卖出回购金融资产投资明细

6.18 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衍生金融工具投资明细

6.19 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其他投资明细

6.20 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资产支持票据投资明细

6.21 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资产支持证券投资基金投资明细

6.22 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其他投资基金投资明细

6.23 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组合

6.24 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债券投资组合

6.25 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贵金属投资组合

6.26 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权证投资组合

6.27 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指期货投资组合

6.28 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国债期货投资组合

6.29 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货币市场基金投资组合

6.30 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存出保证金投资组合

6.31 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买入返售金融资产投资组合

6.32 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应收款项投资组合

6.33 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卖出回购金融资产投资组合

6.34 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衍生金融工具投资组合

6.35 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其他投资组合

6.36 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资产支持证券投资基金投资组合

6.37 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资产支持票据投资基金投资组合

6.38 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其他投资基金投资基金投资组合

6.39 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组合

6.40 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债券投资组合

6.41 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贵金属投资组合

6.42 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权证投资组合

6.43 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指期货投资组合

6.44 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国债期货投资组合

6.45 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货币市场基金投资组合

6.46 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存出保证金投资组合

6.47 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买入返售金融资产投资组合

6.48 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应收款项投资组合

6.49 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卖出回购金融资产投资组合

6.50 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衍生金融工具投资组合

6.51 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其他投资组合

6.52 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资产支持证券投资基金投资基金投资组合

6.53 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资产支持票据投资基金投资基金投资组合

6.54 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其他投资基金投资基金投资组合

6.55 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组合

6.56 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债券投资组合

6.57 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贵金属投资组合

6.58 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权证投资组合

6.59 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指期货投资组合

6.60 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国债期货投资组合

6.61 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货币市场基金投资组合

6.62 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存出保证金投资组合

6.63 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买入返售金融资产投资组合

6.64 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应收款项投资组合

6.65 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卖出回购金融资产投资组合

6.66 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衍生金融工具投资组合

6.67 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其他投资组合

6.68 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资产支持证券投资基金投资基金投资组合

6.69 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资产支持票据投资基金投资基金投资组合

6.70 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其他投资基金投资基金投资组合

6.71 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组合

6.72 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债券投资组合

6.73 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贵金属投资组合

6.74 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权证投资组合

6.75 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指期货投资组合

6.76 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国债期货投资组合

6.77 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货币市场基金投资组合

6.78 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存出保证金投资组合

6.79 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买入返售金融资产投资组合

6.80 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应收款项投资组合

6.81 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卖出回购金融资产投资组合

6.82 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衍生金融工具投资组合

6.8