

工银瑞信信用添利债券型证券投资基金 2011 年半年度报告

2011 年 6 月 30 日

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

送出日期：二〇一一年八月二十九日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 2011 年 8 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2011 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 其他指标.....	9
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
5.3 托管人对半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	14
§6 半年度财务会计报表(未经审计)	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益(基金净值)变动表.....	16
6.4 报表附注.....	17
§7 投资组合报告	36
7.1 期末基金资产组合情况.....	36
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	36
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	38
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	39
7.6 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.....	40
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	40
7.8 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.....	40
7.9 投资组合报告附注.....	40
§8 基金份额持有人信息	41
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	41
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况.....	41

§9 开放式基金份额变动	42
§10 重大事件揭示	42
10.1 基金份额持有人大会决议.....	42
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	42
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	42
10.4 基金投资策略的改变.....	43
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	43
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	43
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	43
10.8 其他重大事件.....	44
§11 影响投资者决策的其他重要信息	44
§12 备查文件目录	45
12.1 备查文件目录.....	45
12.2 存放地点.....	45
12.3 查阅方式.....	45

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	工银瑞信信用添利债券型证券投资基金	
基金简称	工银添利债券	
基金主代码	485107	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2008 年 4 月 14 日	
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	
报告期末基金份额总额	3,807,731,483.23 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	工银添利债券 A	工银添利债券 B
下属分级基金的交易代码:	485107	485007
报告期末下属分级基金的份额总额	2,652,310,023.93 份	1,155,421,459.30 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在控制风险与保持资产流动性的基础上，追求基金资产的长期稳定增值。
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	80%×中债企业债总指数+20%×中债国债总指数
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于低风险基金产品，其长期平均风险和预期收益率低于混合型基金，高于货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		工银瑞信基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	朱碧艳	尹东
	联系电话	010-58698918	010-67595003
	电子邮箱	customerservice@icbccs.com.cn	yindong@ccb.cn
客户服务电话		010-58698918	010-67595096
传真		010-66583158	010-66275853
注册地址		北京市西城区金融大街丙 17 号北京银行大厦	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		北京市西城区金融大街丙 17 号北京银行大厦 8 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		100140	100033

法定代表人	李晓鹏	郭树清
-------	-----	-----

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、证券时报、上海证券报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.icbccs.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	工银瑞信基金管理有限公司	北京经济技术开发区地盛南街 1 号国光高科大厦 4F

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日)	
	A 类	B 类
本期已实现收益	30,506,081.74	12,162,927.04
本期利润	-62,846,245.57	-30,458,796.46
加权平均基金份额本期利润	-0.0227	-0.0238
本期加权平均净值利润率	-2.15%	-2.28%
本期基金份额净值增长率	-2.06%	-2.25%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2011 年 6 月 30 日)	
	A 类	B 类
期末可供分配利润	62,636,892.01	9,565,291.50
期末可供分配基金份额利润	0.0236	0.0083
期末基金资产净值	2,714,946,915.94	1,164,986,750.80
期末基金份额净值	1.0236	1.0083
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2011 年 6 月 30 日)	
	A 类	B 类
基金份额累计净值增长率	26.36%	24.72%

注：1. 所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. 本基金基金合同生效日为 2008 年 4 月 14 日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

工银添利债券 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	-1.09%	0.25%	-0.31%	0.07%	-0.78%	0.18%
过去三个月	-1.65%	0.21%	1.04%	0.06%	-2.69%	0.15%
过去六个月	-2.06%	0.26%	1.24%	0.07%	-3.30%	0.19%
过去一年	-0.15%	0.28%	-0.20%	0.10%	0.05%	0.18%
过去三年	25.55%	0.24%	19.71%	0.17%	5.84%	0.07%
自基金合同生效起至今	26.36%	0.23%	18.25%	0.17%	8.11%	0.06%

工银添利债券 B

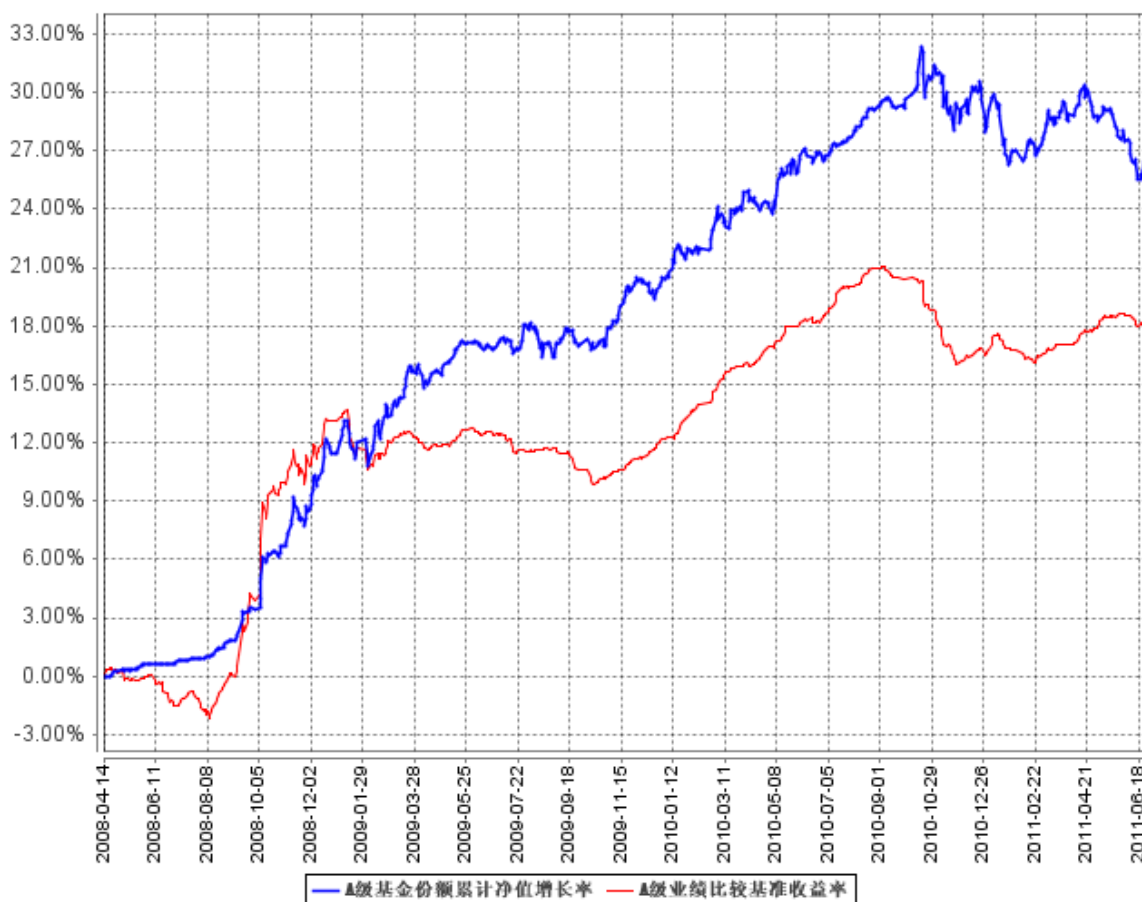
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-1.13%	0.25%	-0.31%	0.07%	-0.82%	0.18%
过去三个月	-1.75%	0.21%	1.04%	0.06%	-2.79%	0.15%
过去六个月	-2.25%	0.26%	1.24%	0.07%	-3.49%	0.19%
过去一年	-0.54%	0.28%	-0.20%	0.10%	-0.34%	0.18%
过去三年	24.03%	0.24%	19.71%	0.17%	4.32%	0.07%
自基金合同生效起至今	24.72%	0.23%	18.25%	0.17%	6.47%	0.06%

注：1 本基金的业绩比较基准为 80%×中债企业债总指数+20%×中债国债总指数，每日进行再平衡过程。

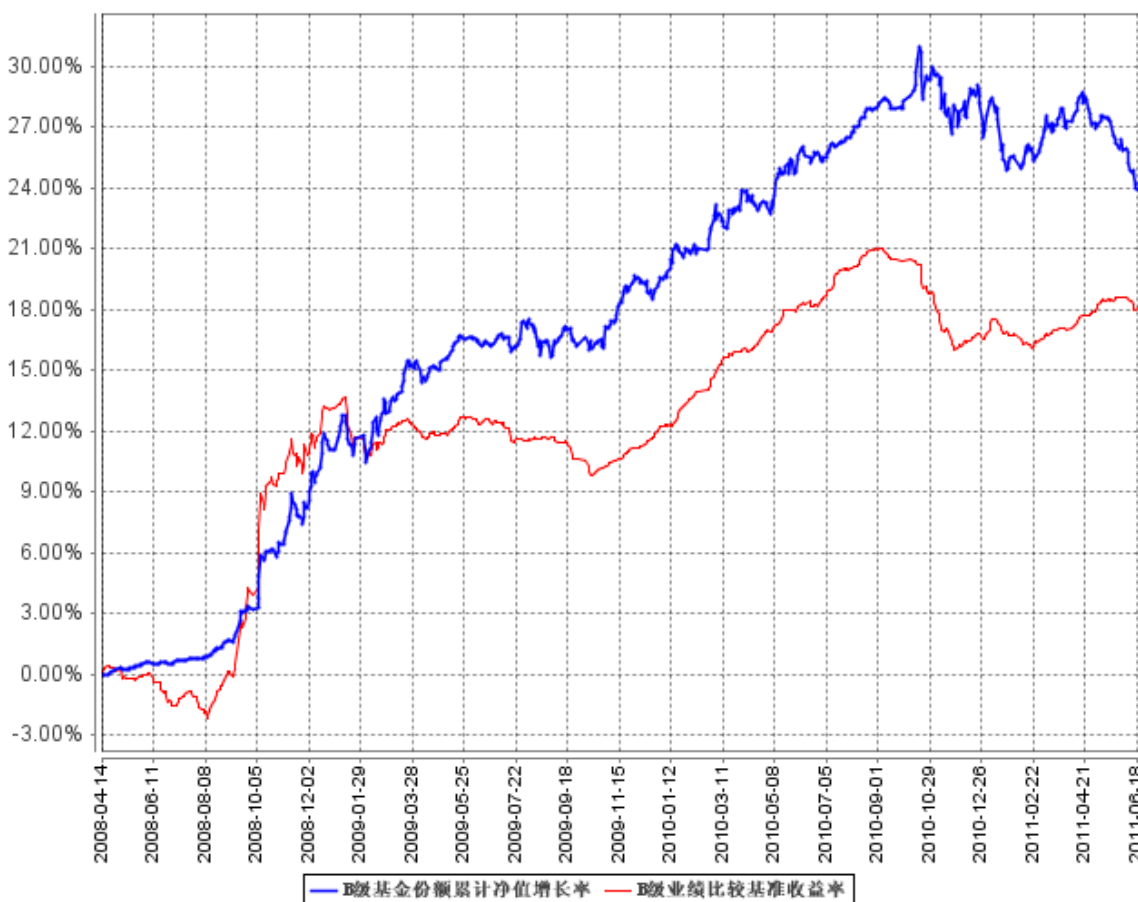
2 本基金基金合同生效日为 2008 年 4 月 14 日。

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

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



B级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金基金合同于 2008 年 4 月 14 日生效，按基金合同规定，本基金建仓期为 6 个月。截至报告期末，本基金的各项投资符合基金合同第十二条（三）投资范围、（七）投资限制中的规定：本基金投资于债券类资产（含可转换债券）的比例不低于基金资产的 80%，本基金持有的公司债券、企业债券、金融债、短期融资券、资产支持证券等除国债、央行票据以外的固定收益类资产投资比例不低于债券类资产的 80%，投资于股票等权益类证券的比例不超过基金资产的 20%，且必须在权益类资产上市交易或流通受限解除后不超过 3 个月的时间内卖出，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，投资于可转换债券的比例不超过基金资产净值的 30%，法律法规及本基金合同规定的其他投资比例限制。

3.3 其他指标

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为工银瑞信基金管理有限公司，成立于 2005 年 6 月 21 日，是我国第一家由银行直接发起设立并控股的合资基金管理公司，注册资本为 2 亿元人民币，注册地在北京。公司目前拥有共同基金募集和管理资格、境外证券投资管理业务资格、企业年金基金投资管理人资格、特定客户资产管理业务资格。2010 年 12 月，公司成为全国社保基金境内投资管理人。

截至 2011 年 6 月 30 日，公司旗下管理 18 只开放式基金——工银瑞信核心价值股票型基金、工银瑞信货币市场基金、工银瑞信精选平衡混合型基金、工银瑞信稳健成长股票型基金、工银瑞信增强收益债券型基金、工银瑞信红利股票型基金、工银瑞信中国机会全球配置股票型基金、工银瑞信信用添利债券型基金、工银瑞信大盘蓝筹股票型基金、工银瑞信沪深 300 指数基金、上证中央企业 50 交易型开放式指数证券投资基金、工银瑞信中小盘成长股票型证券投资基金、工银瑞信全球精选股票型证券投资基金、工银瑞信双利债券型证券投资基金、深证红利交易型开放式指数证券投资基金、工银瑞信深证红利 ETF 联接基金、工银瑞信四季收益债券型证券投资基金以及工银瑞信消费服务行业股票型证券投资基金，证券投资基金管理规模达 563.5 亿元人民币。同时，公司还管理多个专户组合和企业年金组合。资产管理总规模超 900 亿元。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
江明波	固定收益投资总监，本基金的基金经理；工银瑞信四季收益债券型基金的基金经理	2008 年 4 月 14 日	-	11	曾任鹏华基金普天债券基金经理、固定收益负责人；2004 年 6 月至 2006 年 12 月，担任全国社保基金二零四组合和二零四组合基金经理；2006 年加入工银瑞信，现任固定收益投资总监；2008 年 4 月 14 日至今，担任工银添利基金基金经理；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。

注： 1、任职日期说明：江明波的任职日期为基金合同生效的日期。

2、证券从业年限的计算标准：证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定等。

3、本基金无基金经理助理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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；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 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

无，因报告期内本公司旗下没有与本基金投资风格相似的投资组合。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内无异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

影响 2011 年上半年债券市场的走势的核心因素是通货膨胀，年初以来 CPI 一路走高，月度高点不断超越市场预期，在此背景下，央行连续多次提高准备金率，导致资金面异常紧张，货币市

场利率出现了大幅飙升，7 天回购利率在 1 月份和 6 月份曾经到过 8%和 9%的历史高位，中长端债券收益率也大幅上升，央票利率上升约 30BP，金融债上升约 50BP，信用债上升 30-50BP，国债上升幅度最小，上升幅度不超过 10BP。

股票市场同时也受到了通货膨胀高企的影响，在资金面紧张的重压下，转债也以下跌为主。

工银添利在上半年一直维持较高的信用债配置，并进行了结构调整，主要是在利率高位时增持 5 年期可回购债券，减持 3 年及以下期限不可回购债券，提高组合的可融资能力，由于上半年回购利率高企，高杠杆运作并没有带来正收益；我们还保持了中行转债的高配置，该转债的下跌导致基金净值的下跌。我们上半年还持续进行了新股申购，由于今年以来小盘股的泡沫破灭，新股申购并没有带来太多的正收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，工银添利债券 A 的净值增长率为-2.06%，工银添利 B 的净值增长率为-2.25%，业绩比较基准增长率为 1.24%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们预期通胀水平虽然仍将处于高位，但通胀见顶回落是大概率事件，政策的紧缩进入尾声，市场的拐点正在形成。国债收益率今年以来上升较少，相对价值较低，而信用债收益率逼近甚至超过历史高点，利差已接近历史高点，而目前的宏观经济和企业的盈利状况明显优于 2008 年，因此，收益率上升空间非常有限，安全边际高。

我们将继续增持中期信用债，减持短期品种，并将会一直维持较高的信用债仓位；中行转债是性价比最高的转债品种，我们也将保持较高配置。近期新股发行市盈率也有较大程度的下降，系统性风险在逐步降低，我们将坚持在合适的安全边际条件下进行新股申购。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

4.6.1 参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历

4.6.1.1 职责分工

参与估值小组成员为 4 人，分别是公司运作部负责人、研究部负责人、风险管理部负责人和法律合规部负责人，组长由运作部负责人担任。

各部门负责人也可推荐代表各部门参与估值小组的成员，如需更换，由相应部门负责人提出。小组成员需经运作部主管副总批准同意。

4.6.1.2 专业胜任能力及相关工作经历

小组成员由具有多年从事估值运作、证券行业研究、风险管理及熟悉业内法律法规的专家型人员组成。

4.6.2 基金经理参与或决定估值的程度

本公司基金经理参与讨论估值原则及方法，但不参与最终估值决策。

4.6.3 参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4.6.4 已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度

尚无已签约的任何定价服务。本基金所采用的估值流程及估值结果均已经过会计师事务所鉴证，并经托管银行复核确认。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

报告期内，本基金利润分配情况如下：

本基金本期于 2011 年 3 月 10 日发布分红公告，实施了本基金成立以来的第六次分红，2011 年度第一次分红；以每 10 份基金份额派发红利 0.50 元，共计派发红利 200,210,401.14 元，权益登记日为 2011 年 3 月 15 日；

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金实施利润分配的金额工银添利债券 A 为 136,462,751.90 元，工银添利债券 B 为 63,747,649.24 元。

5.3 托管人对半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：工银瑞信信用添利债券型证券投资基金

报告截止日：2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2011 年 6 月 30 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	21,090,571.04	30,106,906.38
结算备付金		50,814,713.84	26,173,740.77
存出保证金		80,698.91	4,624,773.64
交易性金融资产	6.4.7.2	5,855,820,453.71	6,334,145,527.25
其中：股票投资		328,390,028.73	595,234,018.54
基金投资		-	-
债券投资		5,527,430,424.98	5,738,911,508.71
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		2,696,340.19	32,270,110.76
应收利息	6.4.7.5	117,632,994.94	68,073,916.39
应收股利		-	-
应收申购款		407,312.84	3,681,682.08
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		6,048,543,085.47	6,499,076,657.27
负债和所有者权益	附注号	本期末 2011 年 6 月 30 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		2,158,399,318.30	1,819,998,933.30

应付证券清算款		-	-
应付赎回款		4,785,165.51	2,729,874.94
应付管理人报酬		1,957,056.59	2,418,772.47
应付托管费		652,352.17	806,257.50
应付销售服务费		392,988.21	614,109.54
应付交易费用	6.4.7.7	219,181.03	243,710.57
应交税费		-	-
应付利息		1,085,959.60	377,248.72
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	1,117,397.32	857,505.56
负债合计		2,168,609,418.73	1,828,046,412.60
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	3,807,731,483.23	4,282,977,958.36
未分配利润	6.4.7.10	72,202,183.51	388,052,286.31
所有者权益合计		3,879,933,666.74	4,671,030,244.67
负债和所有者权益总计		6,048,543,085.47	6,499,076,657.27

注：报告截止日 2011 年 06 月 30 日，工银添利债券 A 基金份额净值 1.0236 元，基金份额总额 2,652,310,023.93 份；工银添利债券 B 基金份额净值 1.0083 元，基金份额总额 1,155,421,459.30 份；工银添利债券份额总额 3,807,731,483.23 份。

6.2 利润表

会计主体：工银瑞信信用添利债券型证券投资基金

本报告期：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日
一、收入		-39,314,552.53	209,994,501.19
1.利息收入		93,943,293.88	87,038,279.07
其中：存款利息收入	6.4.7.11	732,023.16	834,294.90
债券利息收入		93,197,583.52	86,203,984.17
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		13,687.20	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		2,582,350.32	81,020,592.84
其中：股票投资收益	6.4.7.12	15,624,054.40	57,369,997.03
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-14,249,781.96	23,441,839.25
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	1,208,077.88	208,756.56
3.公允价值变动收益（损失以	6.4.7.16	-135,974,050.81	39,808,469.39

“-”号填列)			
4. 汇兑收益 (损失以“-”号填列)		-	-
5. 其他收入 (损失以“-”号填列)	6. 4. 7. 17	133, 854. 08	2, 127, 159. 89
减: 二、费用		53, 990, 489. 50	34, 788, 408. 27
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	12, 714, 147. 40	11, 356, 414. 62
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	4, 238, 049. 15	3, 760, 747. 50
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	2, 667, 649. 91	3, 424, 119. 36
4. 交易费用	6. 4. 7. 18	1, 456, 875. 30	1, 195, 677. 34
5. 利息支出		32, 649, 272. 00	14, 804, 496. 86
其中: 卖出回购金融资产支出		32, 649, 272. 00	14, 804, 496. 86
6. 其他费用	6. 4. 7. 19	264, 495. 74	246, 952. 59
三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)		-93, 305, 042. 03	175, 206, 092. 92
减: 所得税费用		-	-
四、净利润 (净亏损以“-”号填列)		-93, 305, 042. 03	175, 206, 092. 92

6.3 所有者权益 (基金净值) 变动表

会计主体: 工银瑞信信用添利债券型证券投资基金

本报告期: 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	4, 282, 977, 958. 36	388, 052, 286. 31	4, 671, 030, 244. 67
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	-93, 305, 042. 03	-93, 305, 042. 03
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	-475, 246, 475. 13	-22, 334, 659. 63	-497, 581, 134. 76
其中: 1. 基金申购款	639, 444, 986. 43	36, 847, 946. 43	676, 292, 932. 86
2. 基金赎回款	-1, 114, 691, 461. 56	-59, 182, 606. 06	-1, 173, 874, 067. 62
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的	-	-200, 210, 401. 14	-200, 210, 401. 14

基金净值变动(净值减少以“-”号填列)			
五、期末所有者权益(基金净值)	3,807,731,483.23	72,202,183.51	3,879,933,666.74
项目	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	2,896,897,300.34	372,008,271.60	3,268,905,571.94
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	175,206,092.92	175,206,092.92
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	1,236,285,670.24	194,006,183.04	1,430,291,853.28
其中：1. 基金申购款	3,220,733,828.98	461,178,991.89	3,681,912,820.87
2. 基金赎回款	-1,984,448,158.74	-267,172,808.85	-2,251,620,967.59
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-314,417,506.50	-314,417,506.50
五、期末所有者权益(基金净值)	4,133,182,970.58	426,803,041.06	4,559,986,011.64

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>郭特华</u>	<u>夏洪彬</u>	<u>朱辉毅</u>
基金管理公司负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

工银瑞信信用添利债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2008]第 238 号《关于核准工银瑞信信用添利债券型证券投资基金募集的批复》核准,由工银瑞信基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《工银瑞信信用添利债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 4,828,223,135.44 元,业经普华永道中

天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2008)第 37 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《工银瑞信信用添利债券型证券投资基金基金合同》于 2008 年 4 月 14 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 4,829,064,718.29 份基金份额,其中认购资金利息折合 841,582.85 份基金份额。本基金的基金管理人为工银瑞信基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司(以下简称“中国建设银行”)。

根据《工银瑞信信用添利债券型证券投资基金基金合同》和《工银瑞信信用添利债券型证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案,本基金自募集期起根据认购、申购费用收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购基金时收取认购、申购费用的,称为 A 类基金份额;不收取认购、申购费用,而是在本类别基金资产中计提销售服务费的,称为 B 类基金份额。本基金 A 类、B 类两种收费模式并存,由于基金费用的不同,本基金 A 类基金份额和 B 类基金份额分别计算基金份额净值,计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。投资人可自由选择认购、申购的基金份额类别,两类基金份额之间不能相互转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《工银瑞信信用添利债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括公司债券、企业债券、可转换债券、短期融资券、金融债、资产支持证券、国债、央行票据、债券回购、股票、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资于债券类资产(含可转换债券)的比例不低于基金资产的 80%,其中投资于公司债券、企业债券、金融债、短期融资券、资产支持证券等除国债、央行票据以外的固定收益类资产投资比例不低于债券类资产 80%;投资于股票等权益类证券的比例不高于基金资产的 20%,只通过投资首次发行股票、增发新股、可转换债券转股以及权证行权等方式获得股票,不直接从二级市场买入股票,且必须在权益类资产上市交易或流通受限解除后不超过 3 个月的时间内卖出;现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为 $80\% \times \text{中债企业债总指数} + 20\% \times \text{中债国债总指数}$ 。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会公告[2010]5 号《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《工银瑞信信用添利债券型证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的其他基金行业

实务操作的有关规定编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2011 年 6 月 30 日的财务状况以及 2011 上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

本基金本报告期无需要说明的会计政策和会计估计变更及差错更正事项。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102 号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

- 1、以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。
- 2、基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。
- 3、对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50% 计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即 20% 代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。
- 4、基金买卖股票于 2008 年 4 月 24 日之前按照 0.3% 的税率缴纳股票交易印花税，自 2008 年 4 月 24 日起至 2008 年 9 月 18 日止按 0.1% 的税率缴纳。自 2008 年 9 月 19 日起基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 6 月 30 日
活期存款	21,090,571.04
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-

合计	21,090,571.04
----	---------------

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	364,143,053.78	328,390,028.73	-35,753,025.05	
债券	交易所市场	4,177,575,958.30	4,158,000,324.98	-19,575,633.32
	银行间市场	1,413,997,492.88	1,369,430,100.00	-44,567,392.88
	合计	5,591,573,451.18	5,527,430,424.98	-64,143,026.20
资产支持证券	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	5,955,716,504.96	5,855,820,453.71	-99,896,051.25	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末买入返售金融资产无余额。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易，也无在买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
应收活期存款利息	7,640.14
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	24,514.61
应收债券利息	117,600,840.19
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
其他	-
合计	117,632,994.94

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
交易所市场应付交易费用	198,513.05
银行间市场应付交易费用	20,667.98
合计	219,181.03

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	2,491.02
应交税金	902,133.22
预提审计费	59,507.37
预提信息披露费	148,765.71
预提帐户维护费	4,500.00
合计	1,117,397.32

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

工银添利债券 A		
项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	2,801,039,184.46	2,801,039,184.46
本期申购	404,663,744.06	404,663,744.06
本期赎回(以“-”号填列)	-553,392,904.59	-553,392,904.59
本期末	2,652,310,023.93	2,652,310,023.93

工银添利债券 B		
项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	1,481,938,773.90	1,481,938,773.90
本期申购	234,781,242.37	234,781,242.37
本期赎回(以“-”号填列)	-561,298,556.97	-561,298,556.97
本期末	1,155,421,459.30	1,155,421,459.30

注：“本期申购”中包含红利再投、转换入份额及金额，“本期赎回”中包含转出份额及金额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

工银添利债券 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	192,144,098.08	74,763,872.68	266,907,970.76
本期利润	30,506,081.74	-93,352,327.31	-62,846,245.57
本期基金份额交易产生的变动数	-7,831,043.74	2,868,962.46	-4,962,081.28
其中：基金申购款	18,497,675.03	6,646,292.63	25,143,967.66
基金赎回款	-26,328,718.77	-3,777,330.17	-30,106,048.94
本期已分配利润	-136,462,751.90	-	-136,462,751.90
本期末	78,356,384.18	-15,719,492.17	62,636,892.01

工银添利债券 B			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	81,489,536.95	39,654,778.60	121,144,315.55
本期利润	12,162,927.04	-42,621,723.50	-30,458,796.46
本期基金份额交易产生的变动数	-14,081,557.15	-3,291,021.20	-17,372,578.35
其中：基金申购款	8,378,203.47	3,325,775.30	11,703,978.77
基金赎回款	-22,459,760.62	-6,616,796.50	-29,076,557.12
本期已分配利润	-63,747,649.24	-	-63,747,649.24
本期末	15,823,257.60	-6,257,966.10	9,565,291.50

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
活期存款利息收入	441,748.56
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	290,274.60
其他	-
合计	732,023.16

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
卖出股票成交总额	691,337,137.10

减：卖出股票成本总额	675,713,082.70
买卖股票差价收入	15,624,054.40

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,578,760,549.02
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,555,445,410.53
减：应收利息总额	37,564,920.45
债券投资收益	-14,249,781.96

资产支持证券投资收益

本基金本报告期间无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,208,077.88
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,208,077.88

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
1. 交易性金融资产	-135,974,050.81
——股票投资	-90,710,960.69
——债券投资	-45,263,090.12
——资产支持证券投资	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-135,974,050.81

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	125,605.87
基金转换费收入	8,248.21
合计	133,854.08

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	1,452,375.30
银行间市场交易费用	4,500.00
合计	1,456,875.30

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
审计费用	59,507.37
信息披露费	148,765.71
银行费用	47,222.66
帐户维护费	9,000.00
合计	264,495.74

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**6.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要说明的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系**6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况**

本报告期与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
工银瑞信基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构

中国建设银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
中国工商银行股份有限公司	基金管理人股东、基金代销机构

注：1、本报告期本基金关联方未发生变化。

2、以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011 年6月30日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6 月30日
当期发生的基金应支付的管理费	12,714,147.40	11,356,414.62
其中：支付销售机构的客户维护费	1,549,785.09	1,013,422.77

注：1. 在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 0.60% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.60\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

2. 基金管理费每日计提，按月支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6 月30日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30 日
当期发生的基金应支付的托管费	4,238,049.15	3,760,747.50

注：1. 在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

2. 基金托管费每日计提，按月支付。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年6月30日

	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	工银添利债券 A	工银添利债券 B	合计
工银瑞信基金管理有限公司	-	498,465.53	498,465.53
中国工商银行股份有限公司	-	1,661,691.87	1,661,691.87
中国建设银行股份有限公司	-	92,959.78	92,959.78
合计	-	2,253,117.18	2,253,117.18
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	工银添利债券 A	工银添利债券 B	合计
	工银瑞信基金管理有限公司	-	1,447,347.90
中国工商银行股份有限公司	-	1,530,798.94	1,530,798.94
中国建设银行股份有限公司	-	90,463.71	90,463.71
合计	-	3,068,610.55	3,068,610.55

注：1. A 类基金份额不收取销售服务费，B 类基金份额的销售服务费年费率为 0.40%。本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务。

$$H = E \times 0.40\% / \text{当年天数}$$

H 为 B 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 B 类基金份额前一日基金资产净值

2. 基金销售服务费每日计提，按月支付。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2011年1月1日至2011年6月30日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国建设银行股份有限公司	-	-	-	-	200,000,000.00	161,515.89
上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国建设银行股份有限公司	-	-	-	-	-	-

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日		
	工银添利债券 A	工银添利债券 B	合计
基金合同生效日（2008 年 4 月 14 日）持有的基金份额	-	-	-
期初持有的基金份额	30,008,600.00	-	30,008,600.00
期间申购/买入总份额	-	-	-
期间因拆分变动份额	-	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-	-
期末持有的基金份额	30,008,600.00	-	30,008,600.00
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	1.13%	-	0.79%

项目	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日		
	工银添利债券 A	工银添利债券 B	合计
基金合同生效日（2008 年 4 月 14 日）持有的基金份额	-	-	-
期初持有的基金份额	30,008,600.00	-	30,008,600.00
期间申购/买入总份额	-	-	-
期间因拆分变动份额	-	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-	-
期末持有的基金份额	30,008,600.00	-	30,008,600.00
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	1.40%	-	0.73%

注：1、基金管理人于 2008 年 3 月 25 日通过代销机构在本基金认购期内认购金额为 30,000,000.00 元人民币，认购份额 30,008,600.00 份，认购费为 1,000.00 元。

2、本基金关联方投资本基金时所适用的费率为本基金基金合同中约定的费率。

3、期间申购/买入总份额：含红利再投、转换入份额；期间赎回/卖出总份额：含转换出份额。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末未投资本基金。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年6月30日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	21,090,571.04	441,748.56	19,131,143.35	689,301.29

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与各关联方及托管人股东承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

金额单位：人民币元

工银添利债券A

序号	权益登记日	除息日	每 10 份 基金份 额分 红 数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润分配 合计	备注
1	2011-3-15	2011-3-15	0.500	94,298,736.81	42,164,015.09	136,462,751.90	-
合计	-	-	0.500	94,298,736.81	42,164,015.09	136,462,751.90	-

工银添利债券B

序号	权益登记日	除息日	每 10 份 基金份 额分 红 数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润分配 合计	备注
1	2011-3-15	2011-3-15	0.500	30,729,556.71	33,018,092.53	63,747,649.24	-
合计	-	-	0.500	30,729,556.71	33,018,092.53	63,747,649.24	-

6.4.12 期末（2011年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功 认购日	可流通日	流通受限 类型	认购 价格	期末 估值 单价	数量 (单位：股)	期末 成本总额	期末估值总额	备注
601311	骆驼股份	2011-5-27	2011-9-2	新股流通 受限	18.60	17.44	2,187,808	40,693,228.80	38,155,371.52	-
002588	史丹利	2011-6-3	2011-9-12	新股流通 受限	35.00	31.12	1,200,000	42,000,000.00	37,344,000.00	-

601258	庞大集团	2011-4-20	2011-8-3	新股流通受限	45.00	29.27	579,710	26,086,950.00	16,968,111.70	-
002574	明牌珠宝	2011-4-18	2011-7-22	新股流通受限	32.00	26.77	600,000	19,200,000.00	16,062,000.00	-
300214	日科化学	2011-5-5	2011-8-11	新股流通受限	22.00	21.45	700,000	15,400,000.00	15,015,000.00	-
300225	金力泰	2011-5-25	2011-8-31	新股流通受限	28.00	26.72	480,000	13,440,000.00	12,825,600.00	-
002596	海南瑞泽	2011-6-24	2011-10-10	新股流通受限	12.15	12.15	850,000	10,327,500.00	10,327,500.00	-
300223	北京君正	2011-5-25	2011-8-31	新股流通受限	43.80	40.86	250,000	10,950,000.00	10,215,000.00	-
601058	赛轮股份	2011-6-24	2011-9-30	新股流通受限	6.88	10.02	649,006	4,465,161.28	6,503,040.12	-
601208	东材科技	2011-5-16	2011-8-23	新股流通受限	20.00	21.61	209,836	4,196,720.00	4,534,555.96	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
112029	11 软控债	2011 年 6 月 9 日	2011 年 7 月 25 日	新债未上市	100.00	100.00	500,000	50,000,000.00	50,000,000.00	-
122080	11 康美债	2011 年 6 月 23 日	2011 年 7 月 5 日	新债未上市	100.00	100.00	330,000	33,000,000.00	33,000,000.00	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2011 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 228,399,457.40 元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
080306	08 进出 06	2011 年 7 月 1 日	100.14	700,000	70,098,000.00
080414	08 农发 14	2011 年 7 月 1 日	100.15	1,600,000	160,240,000.00
合计				2,300,000	230,338,000.00

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2011 年 6 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 1,929,999,860.90 元，于 2011 年 7 月 6 日(先后)到期。该类交易要求本基金在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为债券型证券投资基金，属于偏低风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。

公司实行全面、系统的风险管理，风险管理覆盖公司所有战略环节、业务环节和操作环节。同时制定了系统化的风险管理程序，对风险管理的整个流程进行评估和改进。公司构建了分工明确、相互协作、彼此牵制的风险管理组织结构，形成了由四大防线共同筑成的风险管理体系：第一道防线由各个业务部门构成，各业务部门总监作为风险责任人，负责制订本部门的作业流程以及风险控制措施；第二道监控防线由公司专属风险管理部门法律合规部和风险管理部构成，法律合规部负责对公司业务的法律合规风险进行监控管理，风险管理部负责对公司投资管理风险和运作风险进行监控管理；第三道防线是由公司经营管理层和风险管理委员会构成，公司管理层通过执行委员会下的风险管理委员会对风险状况进行全面监督并及时制定相应的对策和实施监控措施；在上述这三道风险监控防线中，公司督察长和监察稽核人员对风险控制措施和合规风险情况进行全面检查、监督，并视所发生问题情节轻重及时反馈给各部门经理、公司总经理、公司治理与风险控制委员会、董事会、监管机构。督察长独立于公司其他业务部门和公司管理层，对内部控制制度的执行情况实行严格检查和及时反馈，并独立报告；第四道监控防线由董事会下属的公司治理与风险控制委员会构成，公司治理与风险控制委员会通过督察长和监察稽核人员的工作，掌握整体风险状况并进行决策。公司治理与风险控制委员会负责检查公司业务的内控制度的实施情况，监督公司对相关法律法规和公司制度的执行。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本公司在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国建设银行，因而与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

于 2010 年 12 月 31 日和 2011 年 6 月 30 日，本基金未持有按短期信用评级的债券投资。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2011 年 6 月 30 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
AAA	1,423,735,207.98	1,411,742,694.70
AAA 以下	3,004,284,217.00	2,882,062,814.01
未评级	-	-
合计	4,428,019,424.98	4,293,805,508.71

注：表中所列示的债券投资为除短期融资券以外的信用债券；债券评级分类取自“北方之星”债券投资分析系统。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理

人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持证券一部分在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除小部分流通受限证券外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。除卖出回购金融资产款余额中有 2,158,399,318.30 元将在 1 个月内到期且计息外，本基金所持有的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2011年6月30 日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	21,090,571.04	-	-	-	-	-	21,090,571.04

结算备付金	50,814,713.84	-	-	-	-	-	50,814,713.84
存出保证金	-	-	-	-	-	80,698.91	80,698.91
交易性金融资产	65,440,557.20	1,327,020,327.70	-	3,729,138,559.28	405,830,980.80	328,390,028.73	5,855,820,453.71
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-2,696,340.19	2,696,340.19
应收利息	-	-	-	-	-	-117,632,994.94	117,632,994.94
应收申购款	-	-	-	-	-	407,312.84	407,312.84
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	137,345,842.01	1,327,028,327.70	-	3,729,138,559.28	405,830,980.80	449,207,375.61	6,048,543,085.47
负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	2,158,399,318.30	-	-	-	-	-	-2,158,399,318.30
应付赎回款	-	-	-	-	-	-4,785,165.51	4,785,165.51
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-1,957,056.59	1,957,056.59
应付托管费	-	-	-	-	-	-652,352.17	652,352.17
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-392,988.21	392,988.21
应付交易费用	-	-	-	-	-	-219,181.03	219,181.03
应付利息	-	-	-	-	-	-1,085,959.60	1,085,959.60
应交税费	-	-	-	-	-	-902,133.22	902,133.22
其他负债	-	-	-	-	-	-215,264.10	215,264.10
负债总计	2,158,399,318.30	-	-	-	-	-10,210,100.43	2,168,609,418.73
利率敏感度缺口	-2,021,053,476.22	1,327,020,327.70	-	3,729,138,559.28	405,830,980.80	438,997,275.18	3,879,933,666.74
上年度末 2010年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	30,106,906.38	-	-	-	-	-	30,106,906.38
结算备付金	26,173,740.77	-	-	-	-	-	26,173,740.77
存出保证金	-	-	-	-	-	-4,624,773.64	4,624,773.64
交易性金融资产	-	-	-1,804,675,294.20	2,172,977,026.11	1,761,259,188.40	595,234,018.54	6,334,145,527.25
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-32,270,110.76	32,270,110.76

应收利息	-	-	-	-	-68,073,916.39	68,073,916.39
应收申购款	-	-	-	-	-3,681,682.08	3,681,682.08
资产总计	56,280,647.15	-1,804,675,294.20	2,172,977,026.11	1,761,259,188.40	703,884,501.41	6,499,076,657.27
负债						
卖出回购金融资产款	1,819,998,933.30	-	-	-	-	-1,819,998,933.30
应付赎回款	-	-	-	-	-2,729,874.94	2,729,874.94
应付管理人报酬	-	-	-	-	-2,418,772.47	2,418,772.47
应付托管费	-	-	-	-	-806,257.50	806,257.50
应付销售服务费	-	-	-	-	-614,109.54	614,109.54
应付交易费用	-	-	-	-	-243,710.57	243,710.57
应付利息	-	-	-	-	-377,248.72	377,248.72
应交税费	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-857,505.56	857,505.56
负债总计	1,819,998,933.30	-	-	-	-8,047,479.30	1,828,046,412.60
利率敏感度缺口	-1,763,718,286.15	-1,804,675,294.20	2,172,977,026.11	1,761,259,188.40	695,837,022.11	4,671,030,244.67

注：表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2011年6月30日）	上年度末（2010年12月31日）
	利率增加 25 基准点	-21,893,133.20	-22,306,352.45
	利率减少 25 基准点	22,134,117.51	22,543,026.69

6.4.13.4.2 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场

交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的其他价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 6 月 30 日		上年度末 2010 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产—股票投资	328,390,028.73	8.46	595,234,018.54	12.74
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	5,527,430,424.98	142.46	5,738,911,508.71	122.86
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	5,855,820,453.71	150.93	6,334,145,527.25	135.60

注：1. 本基金投资于债券类资产(含可转换债券)的比例不低于基金资产的 80%，投资于股票等权益类证券的比例不高于基金资产的 20%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

2. 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。

6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位：人民币元)	
		本期末(2011年6月30日)	上年度末(2010年12月31日)
	业绩比较基准增加 5%	227,665,104.37	196,866,199.40
	业绩比较基准减少 5%	-227,665,104.37	-196,866,199.40

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	328,390,028.73	5.43
	其中：股票	328,390,028.73	5.43
2	固定收益投资	5,527,430,424.98	91.38
	其中：债券	5,527,430,424.98	91.38
	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	71,905,284.88	1.19
6	其他各项资产	120,817,346.88	2.00
7	合计	6,048,543,085.47	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。

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	309,258,164.29	7.97
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	16,683,000.00	0.43
C4	石油、化学、塑胶、塑料	161,632,132.77	4.17
C5	电子	28,335,000.00	0.73
C6	金属、非金属	10,327,500.00	0.27
C7	机械、设备、仪表	76,218,531.52	1.96
C8	医药、生物制品	-	-

C99	其他制造业	16,062,000.00	0.41
D	电力、煤气及水的生产和供应业	2,163,752.74	0.06
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	16,968,111.70	0.44
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	328,390,028.73	8.46

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。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601311	骆驼股份	2,187,808	38,155,371.52	0.98
2	002588	史丹利	1,200,000	37,344,000.00	0.96
3	601216	内蒙君正	1,315,068	31,811,494.92	0.82
4	601011	宝泰隆	1,529,918	27,752,712.52	0.72
5	300195	长荣股份	500,000	20,290,000.00	0.52
6	300193	佳士科技	1,000,000	18,120,000.00	0.47
7	002564	张化机	886,000	17,773,160.00	0.46
8	002568	百润股份	800,000	17,176,000.00	0.44
9	601258	庞大集团	579,710	16,968,111.70	0.44
10	002565	上海绿新	670,000	16,683,000.00	0.43
11	002574	明牌珠宝	600,000	16,062,000.00	0.41
12	300214	日科化学	700,000	15,015,000.00	0.39
13	300225	金力泰	480,000	12,825,600.00	0.33
14	002596	海南瑞泽	850,000	10,327,500.00	0.27
15	300223	北京君正	250,000	10,215,000.00	0.26
16	002250	联化科技	272,205	8,669,729.25	0.22
17	601058	赛轮股份	649,006	6,503,040.12	0.17
18	601208	东材科技	209,836	4,534,555.96	0.12
19	601199	江南水务	147,094	2,163,752.74	0.06

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002588	史丹利	42,000,000.00	0.90
2	002250	联化科技	41,613,277.50	0.89
3	601311	骆驼股份	40,693,228.80	0.87
4	601216	内蒙君正	32,876,700.00	0.70
5	000625	长安汽车	29,220,000.00	0.63
6	002564	张化机	28,320,000.00	0.61
7	601011	宝泰隆	27,538,524.00	0.59
8	300193	佳士科技	26,500,000.00	0.57
9	601258	庞大集团	26,086,950.00	0.56
10	000783	长江证券	22,806,000.00	0.49
11	300167	迪威视讯	22,563,200.00	0.48
12	002565	上海绿新	20,904,000.00	0.45
13	002568	百润股份	20,800,000.00	0.45
14	300195	长荣股份	20,000,000.00	0.43
15	002574	明牌珠宝	19,200,000.00	0.41
16	300214	日科化学	15,400,000.00	0.33
17	601700	风范股份	14,427,035.00	0.31
18	300225	金力泰	13,440,000.00	0.29
19	300223	北京君正	10,950,000.00	0.23
20	002596	海南瑞泽	10,327,500.00	0.22

注：1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票；

2、买入金额按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601018	宁波港	148,806,825.29	3.19
2	601818	光大银行	68,516,373.48	1.47
3	600795	国电电力	61,111,363.50	1.31
4	601717	郑煤机	45,339,249.59	0.97

5	601288	农业银行	39,539,316.24	0.85
6	601006	大秦铁路	33,157,933.47	0.71
7	000625	长安汽车	30,657,438.49	0.66
8	002250	联化科技	27,250,688.86	0.58
9	002500	山西证券	24,270,733.01	0.52
10	300150	世纪瑞尔	21,428,023.69	0.46
11	000783	长江证券	18,896,652.05	0.40
12	002533	金杯电工	18,708,135.35	0.40
13	002506	超日太阳	16,910,407.50	0.36
14	601098	中南传媒	16,590,114.14	0.36
15	300167	迪威视讯	15,224,062.86	0.33
16	300124	汇川技术	12,714,603.86	0.27
17	002564	张化机	12,426,455.98	0.27
18	300134	大富科技	11,975,243.62	0.26
19	601700	风范股份	9,479,342.31	0.20
20	601777	力帆股份	7,865,716.63	0.17

注：1、卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票；

2、卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	499,580,053.58
卖出股票收入（成交）总额	691,337,137.10

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,099,411,000.00	28.34
	其中：政策性金融债	1,099,411,000.00	28.34
4	企业债券	3,273,221,282.18	84.36
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	1,154,798,142.80	29.76
8	其他	-	-

9	合计	5,527,430,424.98	142.46
---	----	------------------	--------

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。

7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113001	中行转债	10,937,660	1,154,798,142.80	29.76
2	080216	08 国开 16	4,500,000	458,325,000.00	11.81
3	080214	08 国开 14	3,900,000	410,748,000.00	10.59
4	122033	09 富力债	2,625,610	273,956,147.40	7.06
5	126018	08 江铜债	3,171,840	253,747,200.00	6.54

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

7.8 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。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 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。

7.9.2 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。

7.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	80,698.91
2	应收证券清算款	2,696,340.19
3	应收股利	-
4	应收利息	117,632,994.94
5	应收申购款	407,312.84
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	120,817,346.88

7.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	113001	中行转债	1,154,798,142.80	29.76

7.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	601311	骆驼股份	38,155,371.52	0.98	新股锁定
2	002588	史丹利	37,344,000.00	0.96	新股锁定
3	601258	庞大集团	16,968,111.70	0.44	新股锁定

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
工银添利债券 A	25,633	103,472.48	2,091,275,697.39	78.85%	561,034,326.54	21.15%
工银添利债券 B	15,431	74,876.64	308,672,087.60	26.72%	846,749,371.70	73.28%
合计	41,064	92,726.76	2,399,947,784.99	63.03%	1,407,783,698.24	36.97%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	工银添利债券 A	798,933.32	0.03%
	工银添利债券 B	2,459,653.21	0.21%
	合计	3,258,586.53	0.09%

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	工银添利债券 A	工银添利债券 B
基金合同生效日（2008 年 4 月 14 日）基金份额总额	2, 257, 211, 189. 56	2, 571, 853, 528. 73
本报告期期初基金份额总额	2, 801, 039, 184. 46	1, 481, 938, 773. 90
本报告期基金总申购份额	404, 663, 744. 06	234, 781, 242. 37
减：本报告期基金总赎回份额	553, 392, 904. 59	561, 298, 556. 97
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	2, 652, 310, 023. 93	1, 155, 421, 459. 30

注：1、总申购份额含红利再投、转换入份额；

2、总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期，本基金未召开持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人：

经工商行政管理部门核准，工银瑞信基金管理有限公司法定代表人变更为李晓鹏先生。基金管理人已于 2011 年 2 月 24 日对外披露上述事项。

2、基金托管人托管部门：

本基金托管人 2011 年 2 月 9 日发布公告，经中国建设银行研究决定，聘任杨新丰为中国建设银行投资托管服务部副总经理（主持工作），其任职资格已经中国证监会审核批准（证监许可（2011）115 号）。解聘罗中涛中国建设银行投资托管服务部总经理职务。

本基金托管人 2011 年 1 月 31 日发布任免通知，解聘李春信中国建设银行投资托管服务部副总经理职务。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

无。

10.4 基金投资策略的改变

无。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期没有改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

无。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长江证券	1	457,194,319.21	66.13%	388,619.70	67.13%	-
中信建投	1	234,142,817.89	33.87%	190,243.37	32.87%	-

注：1. 券商的选择标准和程序

(1) 选择标准：注重综合服务能力

a) 券商财务状况良好、经营行为规范、风险管理先进、投资风格与工银瑞信有互补性、在最近一年内无重大违规行为。

b) 券商具有较强的综合研究能力：能及时、全面、定期提供高质量的关于宏观、行业、资本市场、个股分析的报告及其他丰富全面的信息咨询服务；有很强的分析能力，能根据工银瑞信所管理基金的特定要求，提供专门研究报告；具有开发量化投资组合模型的能力以及其他综合服务能力。

c) 与其他券商相比，该券商能够提供最佳交易执行和优惠合理的佣金率。

(2) 选择程序

a) 确定券商数量：根据以上标准对不同券商进行考察、选择和确定。投资研究部门（权益投资部，固定收益部，专户投资部，研究部和中央交易室）根据公司基金规模和服务需求等因素确定对合作券商的数量，每年根据公司经营规模变化及券商评估结果决定是否需要新增或调整合作券商，选定的名单需经主管投资副总和总经理审批同意。

b) 签订委托协议：与被选择的券商签订委托代理协议，明确签定协议双方的公司名称、委托代理期限、佣金率、双方的权利义务等，经签章有效。委托代理协议一式五份，协议双方及证券主管机关各留存一份，工银瑞信法律合规部留存备案，并报相关证券主管机关留存报备。

2. 券商的评估，保留和更换程序

(1) 席位的租用期限暂定为一年，合同到期 15 天内，投资研究部门将根据各券商研究在服务期间的综合证券服务质量等情况，进行评估。

(2) 对于符合标准的券商，工银瑞信将与其续约；对于不能达到标准的券商，不与其续约，并根据券商选择标准和程序，重新选择其它经营稳健、研究能力强、综合服务质量高的证券经营机构，租用其交易席位。

(3) 若券商提供的综合证券服务不符合要求，工银瑞信有权按照委托协议规定，提前中止租用其交易席位。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
长江证券	1,138,933,618.19	75.58%	41,565,700,000.00	90.12%	-	-
中信建投	368,036,677.42	24.42%	4,555,001,000.00	9.88%	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	工银瑞信信用添利债券型证券投资基金 2010 年第 4 季度报告	三大报、公司网站	2011 年 1 月 24 日
2	工银瑞信信用添利债券型证券投资基金第六次分红公告	三大报、公司网站	2011 年 3 月 10 日
3	工银瑞信信用添利债券型证券投资基金 2010 年度报告	三大报、公司网站	2011 年 3 月 26 日
4	工银瑞信信用添利债券型证券投资基金 2011 年第 1 季度报告	三大报、公司网站	2011 年 4 月 23 日

注：三大报包括中国证券报、上海证券报、证券时报。

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会批准工银瑞信信用添利债券型证券投资基金募集的文件
- (二) 《工银瑞信信用添利债券型证券投资基金基金合同》
- (三) 《工银瑞信信用添利债券型证券投资基金托管协议》
- (四) 《工银瑞信信用添利债券型证券投资基金招募说明书》
- (五) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (六) 基金托管人业务资格批件、营业执照
- (七) 报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告

12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的办公场所。

12.3 查阅方式

投资者可于营业时间查阅，或登录基金管理人网站查阅。

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。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人工银瑞信基金管理有限公司。

客户服务中心电话：010-58698918，400-811-9999

网址：www.icbccs.com.cn