

# 工银瑞信中国机会全球配置股票型证券投资 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2011 年 8 月 19 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

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
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 境外投资顾问和境外资产托管人.....	6
2.5 信息披露方式.....	6
2.6 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
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.....	8
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介.....	10
4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	11
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
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.....	12
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.....	13
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>13</b>
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>34</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	34
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	34
7.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	35
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细.....	35
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动.....	49
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	51
7.7 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.....	51
7.8 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.....	51
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细.....	51
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细.....	51

7.11 投资组合报告附注 .....	51
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>52</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	52
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 .....	52
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>52</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>53</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	53
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 .....	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	53
10.4 基金投资策略的改变 .....	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	53
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 .....	53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	54
10.8 其他重大事件 .....	56
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>56</b>
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>56</b>
12.1 备查文件目录 .....	56
12.2 存放地点 .....	57
12.3 查阅方式 .....	57

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	工银瑞信中国机会全球配置股票型证券投资基金
基金简称	工银全球股票 (QDII)
基金主代码	486001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008 年 2 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	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,237,594,809.03 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	全球范围内受益于中国经济持续增长的公司。
投资策略	通过在全球范围内分散投资，围绕着控制投资组合风险，追求基金长期资产增值并战胜业绩基准。
业绩比较基准	40%×MSCI 中国指数收益率+60%×MSCI 全球股票指数收益率
风险收益特征	本基金属于全球股票型基金，在一般情况下，其风险与预期收益高于债券型基金，亦高于混合型基金。

### 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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	朱碧艳	唐州徽
	联系电话	010-58698918	010-66594855
	电子邮箱	customerservice@icbccs.com.cn	tgxxpl@bank-of-china.com
客户服务电话		010-58698918	95566
传真		010-66583158	010-66594942
注册地址		北京市西城区金融大街丙 17 号北京银行大厦	北京西城区复兴门内大街 1 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	北京西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		100140	100818
法定代表人		李晓鹏	肖钢

## 2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	-	Citibank N.A.
	中文	-	美国花旗银行有限公司
注册地址		-	3900 Paradise Road, Suite 127, Las Vegas, Nevada 89109, USA
办公地址		-	399 Park Avenue, New York, NY10022, USA
邮政编码		-	10022

注：本基金无境外投资顾问。

## 2.5 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住所

## 2.6 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-2011年6月30日)
本期已实现收益	80,625,141.49
本期利润	-8,527,745.88
加权平均基金份额本期利润	-0.0062
本期加权平均净值利润率	-0.62%
本期基金份额净值增长率	-1.00%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2011年6月30日)
期末可供分配利润	-46,448,508.63
期末可供分配基金份额利润	-0.0375
期末基金资产净值	1,228,063,574.98
期末基金份额净值	0.992

3.1.3 累计期末指标	报告期末(2011年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-0.80%

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 2 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

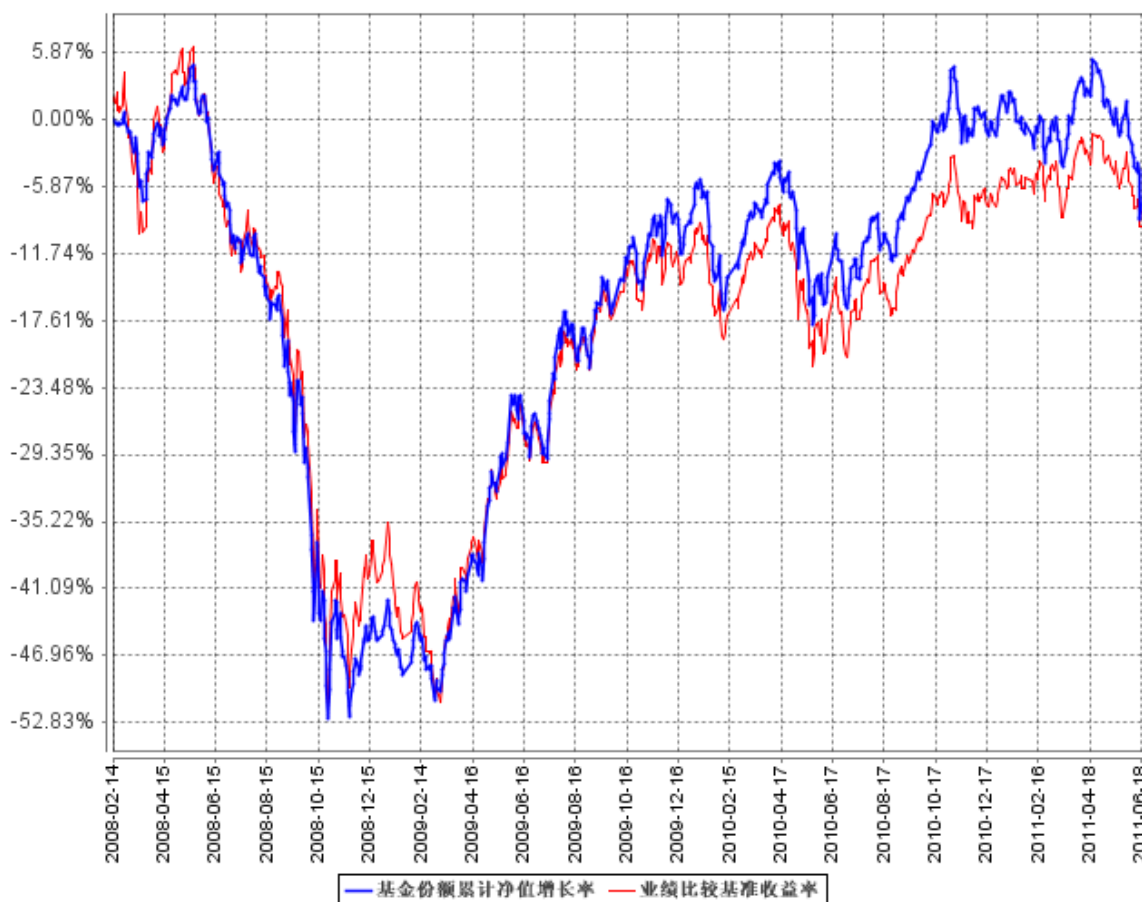
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-2.36%	1.35%	-2.62%	0.85%	0.26%	0.50%
过去三个月	-2.36%	1.01%	-1.71%	0.79%	-0.65%	0.22%
过去六个月	-1.00%	0.92%	1.32%	0.80%	-2.32%	0.12%
过去一年	16.57%	0.87%	17.57%	0.81%	-1.00%	0.06%
过去三年	7.01%	1.54%	3.95%	1.67%	3.06%	-0.13%
自基金合同生效起至今	-0.80%	1.47%	-5.36%	1.64%	4.56%	-0.17%

注：1、本基金的业绩比较基准为 40%×MSCI 中国指数收益率+60%×MSCI 全球股票指数收益率，每日进行再平衡过程；

2、本基金基金合同生效日为 2008 年 2 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

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 2 月 14 日生效。按照工银全球基金的基金合同规定，本基金的建仓期为 6 个月，截至报告期末本基金的各项投资符合本基金合同第十四条（二）投资范围、（七）投资限制的有关约定。

### 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		
郝康	国际业务总监；本基金的基金经理	2008年2月14日	-	16	先后在首源投资管理公司担任基金经理，联和运通投资顾问管理公司担任执行董事，北京博动科技有限责任公司担任执行董事和财务总监；2007年加入工银瑞信，现任国际业务总监；2008年2月14日至今，担任工银全球基金基金经理。
游凇峰	本基金的基金经理；工银全球精选基金基金经理	2009年12月25日	-	18	先后在 Merrill Lynch Investment Managers 担任美林集中基金和美林保本基金基金经理，Fore Research & Management 担任 Fore Equity Market Neutral 组合基金经理，Jasper Asset Management 担任 Jasper Gemini Fund 基金基金经理；2009年加入工银瑞信基金管理有限公司；2009年12月25日至今，担任工银全球基金的基金经理；2010年5月25日至今，担任工银全球精选基金的基金

					经理。
--	--	--	--	--	-----

注：1、任职日期说明：

- 1) 郝康的任职日期为基金合同生效的日期；
  - 2) 游凜峰的任职日期为公司执委会决议日期。
- 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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

无。

#### 4.3 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，本基金管理人认真遵循《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，无损害基金持有人利益的行为。

#### 4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.4.1 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。

##### 4.4.2 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。

##### 4.4.3 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。

## 4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2011 年上半年全球资本市场动荡不已。除了中国实体经济与政策响应的反复外，美国经济复苏的步伐与政策变化（主要是围绕着量化宽松政策的延续），欧洲希腊以及后来意大利债务危机的起起伏伏也对投资者造成极大的困扰。此外，二季度中期对在美国上市的中国公司的财务造假质疑以及随后的做空势头也加大了海外中国股票市场的波动。

回顾上半年的投资操作，我们在市场的整体节奏上把握不错。年初我们的组合比较进取，超配资本品。进入二季度后则出于对中国通胀的担忧而转趋谨慎。但遗憾的是进入二季度，由于对中国经济硬着陆的担忧，中小市值股票受到抛售，市场几乎没有任何承接力。这在一定程度上影响了基金的净值表现。此外，基金在二季度市场下跌同时出现较大规模赎回，从而在很大程度上抵消了我们积极减仓的效果。

### 4.5.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金净值增长率为-1.00%，业绩比较基准增长率为 1.32%。

## 4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

全球主要经济体复苏的步伐明显不同，这使得市场的波动更为剧烈。尽管以美国为主的成熟市场经济复苏较预期缓慢，但我们也观察到伴随着原油等大宗原材料价格的回落，企业层面的盈利增长显示出较为强劲的迹象。股票市场的估值优势在经过了 2 季度的回调之后也开始凸显出来。

在新兴市场方面，各国政府自去年来采取的紧缩政策陆续见效，对通胀的担忧逐步减轻。经过了 2 季度的反复之后，我们预期通胀在中国也将很快见顶回落，宏观政策将会朝保增长的方向倾斜。这对未来股市的表现将是一个积极的信号。

在行业的配置上，企业自身的投资和产业升级需求将是一个重要投资主题。另外，政府政策主导的领域也有望获得较好的投资回报。

## 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

4.7.1 参与估值流程各方及人员或小组的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历

4.7.1.1 职责分工

4.7.1.1.1 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、法律合规部负责人，组长由运作部负责人担任。

4.7.1.1.2 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。

4.7.1.2 专业胜任能力及相关工作经历

小组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。

4.7.2 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。

4.7.3 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。

4.7.4 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。

## 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

报告期内，本基金无可供分配收益，根据相关法律法规和本基金合同约定，本基金不进行收益分配。

## § 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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对工银瑞信中国机会全球配置股票型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议

的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对本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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## § 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：工银瑞信中国机会全球配置股票型证券投资基金

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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	75,596,784.31	98,520,468.60
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	1,128,893,107.57	1,442,191,976.98
其中：股票投资		1,128,893,107.57	1,442,191,976.98
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	286,172.82	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		24,257,603.92	9,397,414.82
应收利息	6.4.7.5	18,291.73	20,580.54
应收股利		3,626,065.34	268,292.79
应收申购款		85,911.29	600,280.32
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,232,763,936.98	1,550,999,014.05
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2011 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2010 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
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		-	-

应付证券清算款		-	-
应付赎回款		2,433,837.00	6,397,453.75
应付管理人报酬		1,767,729.29	2,372,725.55
应付托管费		294,621.55	395,454.24
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	-	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	204,174.16	534,941.08
负债合计		4,700,362.00	9,700,574.62
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	1,237,594,809.03	1,537,686,135.05
未分配利润	6.4.7.10	-9,531,234.05	3,612,304.38
所有者权益合计		1,228,063,574.98	1,541,298,439.43
负债和所有者权益总计		1,232,763,936.98	1,550,999,014.05

注：报告截止日 2011 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.992 元，基金份额总额 1,237,594,809.03 份。

## 6.2 利润表

会计主体：工银瑞信中国机会全球配置股票型证券投资基金

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
<b>一、收入</b>		9,802,293.18	-105,512,951.67
1. 利息收入		185,116.20	201,175.23
其中：存款利息收入	6.4.7.11	185,116.20	201,175.23
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		99,807,341.83	149,017,043.06
其中：股票投资收益	6.4.7.12	85,438,593.09	132,330,808.28
基金投资收益	6.4.7.13	-	-
债券投资收益	6.4.7.14	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	1,747,757.76	941,631.63
股利收益	6.4.7.16	12,620,990.98	15,744,603.15
3. 公允价值变动收益（损失以“-”	6.4.7.17	-89,152,887.3	-251,638,880.73

号填列)		7	
4. 汇兑收益 (损失以“-”号填列)		-1,078,901.61	-3,456,277.87
5. 其他收入 (损失以“-”号填列)	6.4.7.18	41,624.13	363,988.64
<b>减: 二、费用</b>		18,330,039.06	23,784,938.99
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	12,335,435.77	16,037,320.58
2. 托管费	6.4.10.2.2	2,055,905.99	2,672,886.73
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	3,555,543.41	4,428,476.45
5. 利息支出		-	-
其中: 卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	383,153.89	646,255.23
<b>三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)</b>		-8,527,745.88	-129,297,890.66
减: 所得税费用		-	-
<b>四、净利润 (净亏损以“-”号填列)</b>		-8,527,745.88	-129,297,890.66

### 6.3 所有者权益 (基金净值) 变动表

会计主体: 工银瑞信中国机会全球配置股票型证券投资基金

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)	1,537,686,135.05	3,612,304.38	1,541,298,439.43
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	-8,527,745.88	-8,527,745.88
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)	-300,091,326.02	-4,615,792.55	-304,707,118.57
其中: 1. 基金申购款	31,117,480.79	193,521.65	31,311,002.44
2. 基金赎回款	-331,208,806.81	-4,809,314.20	-336,018,121.01
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)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	1,237,594,809.03	-9,531,234.05	1,228,063,574.98
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)	2,052,375,849.82	-170,756,260.40	1,881,619,589.42
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	-129,297,890.66	-129,297,890.66
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)	-107,503,865.13	9,865,189.54	-97,638,675.59
其中：1. 基金申购款	122,846,718.55	-10,391,458.69	112,455,259.86
2. 基金赎回款	-230,350,583.68	20,256,648.23	-210,093,935.45
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)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	1,944,871,984.69	-290,188,961.52	1,654,683,023.17

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

工银瑞信中国机会全球配置股票型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监基金字[2007]325 号文《关于同意工银瑞信中国机会全球配置股票型证券投资基金募集的批复》批准，由工银瑞信基金管理有限公司作为发起人依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》和《工银瑞信中国机会全球配置股票型证券投资基金基金合同》于 2008 年 1 月 3 日至 2008 年 2 月 1 日向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所验证并出具安永华明（2008）验字第 60438506\_A01 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。

《工银瑞信中国机会全球配置股票型证券投资基金基金合同》于 2008 年 2 月 14 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 3,154,809,691.49 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 1,006,944.51 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 3,155,816,636.00 元，折合 3,155,816,636.00 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，注册登记机构为工银瑞信基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司，境外资产托管人为美国花旗银行有限公司（Citibank N.A.）。



根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》和《工银瑞信中国机会全球配置股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括：在香港等境外证券市场上市的中国公司股票，全球范围内受惠于中国经济增长的境外公司股票，以及政府债券、回购、股票指数期货、外汇远期合约、外汇互换及其他用于组合避险或有效管理的金融衍生工具。其中，投资于香港等境外证券市场上市的中国公司股票的资产为中国公司组合，投资于全球范围内受惠于中国经济增长的境外公司股票的资产为全球公司组合，中国公司组合占基金资产的比例为 30%-50%，全球公司组合占基金资产的比例为 50%-70%。本基金持有的股票资产占基金资产的比例不低于 60%，政府债券、回购、股票指数期货、外汇远期合约、外汇互换及其他用于组合避险或有效管理的金融衍生工具占基金资产的比例不高于 40%。本基金的业绩比较基准为  $40\% \times \text{MSCI 中国指数收益率} + 60\% \times \text{MSCI 全球股票指数收益率}$ 。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定（统称“企业会计准则”）、中国证券业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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〉》及其他中国证监会颁布的相关规定而编制。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 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于 2011 年 6 月 30 日的财务状况以及 2011 年上半年的经营成果和净值变动情况。

#### 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

无。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，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) 基金买卖股票的差价收入暂免征营业税和企业所得税；
- (3) 基金取得的源自境外证券市场的收益，其涉及的税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行。

#### 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	75,596,784.31
定期存款	-
其他存款	-
合计：	75,596,784.31

##### 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	986,835,792.65	1,128,893,107.57	142,057,314.92
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	986,835,792.65	1,128,893,107.57	142,057,314.92

## 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日			备注
	合同/名义金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	-	286,172.82	-	
权证	-	286,172.82	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	-	286,172.82	-	

## 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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

## 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有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	18,291.73
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	-
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
其他	-
合计	18,291.73

## 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

本基金本报告期末未有应付交易费用。

## 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	858.67
预提费用	203,315.49
合计	204,174.16

## 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,537,686,135.05	1,537,686,135.05
本期申购	31,117,480.79	31,117,480.79
本期赎回(以“-”号填列)	-331,208,806.81	-331,208,806.81
本期末	1,237,594,809.03	1,237,594,809.03

## 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-146,990,007.68	150,602,312.06	3,612,304.38
本期利润	80,625,141.49	-89,152,887.37	-8,527,745.88
本期基金份额交易产生的变动数	19,916,357.56	-24,532,150.11	-4,615,792.55
其中：基金申购款	-2,284,500.49	2,478,022.14	193,521.65
基金赎回款	22,200,858.05	-27,010,172.25	-4,809,314.20
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-46,448,508.63	36,917,274.58	-9,531,234.05

## 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	184,499.16
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	-
其他	617.04
合计	185,116.20

#### 6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
卖出股票成交总额	1,362,038,065.72
减：卖出股票成本总额	1,276,599,472.63
买卖股票差价收入	85,438,593.09

注：“买卖股票差价收入”包含认沽权证行权产生的买卖股票差价收入。

#### 6.4.7.13 基金投资收益

本基金本报告期无基金投资收益。

#### 6.4.7.14 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

##### 6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
卖出权证成交总额	498,090.83
减：卖出权证成本总额	15.70
买卖权证差价收入	498,075.13

注：“买卖权证差价收入”包含权证行权产生的差价收入。

##### 6.4.7.15.2 其他衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
股指期货平仓及交割损益	1,249,682.63

#### 6.4.7.16 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	12,620,990.98
基金投资产生的股利收益	-
合计	12,620,990.98

## 6.4.7.17 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	-89,319,784.47
——股票投资	-89,319,784.47
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
2. 衍生工具	166,897.10
——权证投资	166,897.10
3. 其他	-
合计	-89,152,887.37

## 6.4.7.18 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	41,624.13
合计	41,624.13

## 6.4.7.19 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	3,555,543.41
银行间市场交易费用	-
合计	3,555,543.41

## 6.4.7.20 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	54,547.97
信息披露费	148,767.52
其他	50,779.08
税费	122,544.21
银行汇划费	6,515.11
合计	383,153.89

#### 6.4.7.21 分部报告

本基金目前以一个经营分部运作，取得的收入按国家或地区列示如下：

单位：人民币元

收入	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
中国香港	2,572,954.42
美国	10,508,587.00
澳大利亚	-302,515.45
新加坡	-5,611,476.37
欧元区	6,548,577.08
印度尼西亚	2,562,181.33
英国	-528,216.49
其他	-5,947,798.34
合计	9,802,293.18

注：权益投资收入的国家或地区类别根据其所在证券交易所确定。

截至2011年6月30日止，本基金无非流动资产。

#### 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

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大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、基金销售机构、基金注册登记机构

中国银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
瑞士信贷	基金管理人股东

注：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

##### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：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	
	成交金额	占当期股票成交 总额的比例	成交金额	占当期股票成交 总额的比例
瑞士信贷	985,552,744.29	40.90%	1,203,975,880.22	39.35%

##### 6.4.10.1.2 权证交易

金额单位：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	
	成交金额	占当期权证 成交总额的比例	成交金额	占当期权证 成交总额的比例
瑞士信贷	75,592.47	100%	-	-

##### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例	期末应付佣 金余额	占期末应付佣 金总额的比例
瑞士信贷	372,540.40	19.02%	-	-
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 佣金	占当期佣金总量 的比例	期末应付佣 金余额	占期末应付佣 金总额的比例
瑞士信贷	528,866.18	16.80%	-	-

注：1、上述佣金按市场佣金率计算。



2、该类佣金协议的范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

#### 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	12,335,435.77	16,037,320.58
其中：支付销售机构的客户维护费	2,923,229.91	3,798,063.38

注：1、基金管理费按前一估值日基金资产净值的1.8%的年费率计提，计算方法如下：

$$H=E \times 1.8\% / \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一估值日基金资产净值

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	2,055,905.99	2,672,886.73

注：1、基金托管费按前一估值日基金资产净值的0.3%的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.3\% / \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一估值日的基金资产净值

2、基金托管费每日计提，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

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 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

本基金的管理人在本报告期内与上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

**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及上年度末均未投资本基金。

**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
中国银行股份有限公司	15,414,784.28	78,337.48	21,716,131.99	113,711.91

**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未在承销期内参与上述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**

本基金在 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日止会计期间未进行利润分配。

**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**

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

**6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

**6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**

本基金本报告期末无正回购余额，因此没有作为抵押的债券。

**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**

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人的风险管理机构由董事会下属的公司治理与风险控制委员会、督察长、公司风险管理委员会、法律合规部、风险管理部以及各个业务部门组成。

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和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，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于远期合约、互换等柜台交易金融衍生品时，要求所有参与交易对手方（中资商业银行除外）应当具有不低于中国证监会认可的信用评级机构评级，并且任一交易对手方的市值计价敞口不得超过基金资产净值的 20%。

##### 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

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

#### 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。

由于流动性管理及策略性投资的需要，本基金将持有一些期限在一年以内的政府债券、回购等货币市场工具。

#### 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

利率风险是指基金的财务状况和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。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。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。

##### 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	75,596,784.31	-	-	-	-	-	75,596,784.31
结算备付金	-	-	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融资 产	-	-	-	-	-	1,128,893,107.57	1,128,893,107.57
衍生金融资产	-	-	-	-	-	286,172.82	286,172.82
买入返售金融 资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算	-	-	-	-	-	24,257,603.92	24,257,603.92

款							
应收利息	-	-	-	-	-	18,291.73	18,291.73
应收股利	-	-	-	-	-	3,626,065.34	3,626,065.34
应收申购款	5,659.81	-	-	-	-	80,251.48	85,911.29
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	75,602,444.12	-	-	-	-	1,157,161,492.86	1,232,763,936.98
负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	2,433,837.00	2,433,837.00
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,767,729.29	1,767,729.29
应付托管费	-	-	-	-	-	294,621.55	294,621.55
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	204,174.16	204,174.16
负债总计	-	-	-	-	-	4,700,362.00	4,700,362.00
利率敏感度缺口	75,602,444.12	-	-	-	-	1,152,461,130.86	1,228,063,574.98
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	98,520,468.60	-	-	-	-	-	98,520,468.60
结算备付金	-	-	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,442,191,976.98	1,442,191,976.98
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-

买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	9,397,414.82	9,397,414.82
应收利息	-	-	-	-	-	20,580.54	20,580.54
应收股利	-	-	-	-	-	268,292.79	268,292.79
应收申购款	4,968.20	-	-	-	-	595,312.12	600,280.32
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	98,525,436.80	-	-	-	-	1,452,473,577.25	1,550,999,014.05
负债	-	-	-	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	6,397,453.75	6,397,453.75
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,372,725.55	2,372,725.55
应付托管费	-	-	-	-	-	395,454.24	395,454.24
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	534,941.08	534,941.08
负债总计	-	-	-	-	-	9,700,574.62	9,700,574.62
利率敏感度缺口	98,525,436.80	-	-	-	-	1,442,773,002.63	1,541,298,439.43

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

于 2011 年 6 月 30 日及 2010 年 12 月 31 日，本基金未持有债券投资，因此市场利率的变动对本基金资产净值无重大影响。

## 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

## 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日						
	港币 折合人民币	美元 折合人民币	日元 折合人民币	欧元 折合人民币	韩元 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
<b>以外币计价的资产</b>							
银行存款	31,570,041.62	19,247,057.48	-	5.62	-	9,365,728.53	60,182,833.25
交易性金融资产	413,722,446.69	483,559,232.61	25,637,638.51	49,975,456.49	34,984,086.43	121,014,246.84	1,128,893,107.57
衍生金融资产	167,654.59	118,518.23	-	-	-	-	286,172.82
应收证券清算款	-	20,162,649.56	-	-	1,927,488.30	2,167,466.06	24,257,603.92
应收利息	275.84	-	-	-	-	14,766.76	15,042.60
应收股利	2,256,048.95	465,233.03	-	-	-	106,100.86	2,827,382.84
资产总计	447,716,467.69	523,552,690.91	25,637,638.51	49,975,462.11	36,911,574.73	132,668,309.05	1,216,462,143.00
<b>以外币计价的负债</b>							
负债合计	-	-	-	-	-	-	-
<b>资产负债表外汇风险敞口净额</b>	447,716,467.69	523,552,690.91	25,637,638.51	49,975,462.11	36,911,574.73	132,668,309.05	1,216,462,143.00

项目	上年度末 2010年12月31日						
	港币 折合人民币	美元 折合人民币	日元 折合人民币	欧元 折合人民币	巴西雷亚尔 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
<b>以外币计价的资产</b>							
银行存款	44,131,075.10	15,577,598.77	-	-	55,280	15,775,625.12	75,539,578.99
交易性金融资产	644,195,015.47	474,395,575.33	47,438,897.29	47,230,760.83	40,873,352.69	188,058,375.37	1,442,191,976.98
衍生金融资产							-
应收证券清算款	3,906,974.08	1,556,543.38	3,933,897.36	-	-	-	9,397,414.82
应收利息	335.07	-	-	-	-	13,668.1	14,003.17
应收股利	25,527.9	122,879.43	34,007.31	-	85,878.15	-	268,292.79
资产总计	692,258,927.62	491,652,596.91	51,406,801.96	47,230,760.83	41,014,510.84	203,847,668.59	1,527,411,266.75

以外币计价的负债							
负债合计	-	-	-	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	692,258,927.62	491,652,596.91	51,406,801.96	47,230,760.83	41,014,510.84	203,847,668.59	1,527,411,266.75

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变，且未考虑基金管理人为降低汇率风险而可能采取的风险管理活动。		
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）
	港币相对人民币升值5%	22,385,823.38	34,612,946.38
	港币相对人民币贬值5%	-22,385,823.38	-34,612,946.38
	美元相对人民币升值5%	26,177,634.55	24,582,629.85
	美元相对人民币贬值5%	-26,177,634.55	-24,582,629.85
	日元相对人民币升值5%	1,281,881.93	2,570,340.10
	日元相对人民币贬值5%	-1,281,881.93	-2,570,340.10
	欧元相对人民币升值5%	2,498,773.11	2,361,538.04
	欧元相对人民币贬值5%	-2,498,773.11	-2,361,538.04
	韩元相对人民币升值5%	1,845,578.74	-
	韩元相对人民币贬值5%	-1,845,578.74	-
	巴西雷亚尔相对人民币升值5%	-	2,050,725.54
	巴西雷亚尔相对人民币贬值5%	-	-2,050,725.54

注：1、表中列示了当年以外币计价的资产中前五大币种的汇率变动对基金资产净值的影响。

2、标记“-”处，表示当年该币种的汇率风险较小。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险



其他价格风险主要为市场价格风险，市场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其他价格因素变动而发生波动的风险。本基金的投资范围包括：在香港等境外证券市场上市的中国公司股票，全球范围内受惠于中国经济增长的境外公司股票，以及政府债券、回购、股票指数期货、外汇远期合约、外汇互换及其他用于组合避险或有效管理的金融衍生工具，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

#### 6.4.13.4.3.1 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	1,128,893,107.57	91.92	1,442,191,976.98	93.57
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	286,172.82	0.02	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,129,179,280.39	91.95	1,442,191,976.98	93.57

注：1. 本基金持有的股票等权益类资产占基金资产的比例不低于 60%。其中，投资于香港等境外证券市场上市的中国公司股票的资产为中国公司组合，投资于全球范围内受惠于中国经济增长的境外公司股票的资产为全球公司组合，中国公司组合占基金资产的比例为 30%-50%，全球公司组合占基金资产的比例为 50%-70%。

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。

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变；		
	用期末时点比较基准浮动 5%基金资产净值相应变化来估测组合市场价格风险；		
	Beta 系数是根据组合的净值数据和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性。		
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%	61,207,921.70	73,551,088.36
	业绩比较基准减少 5%	-61,207,921.70	-73,551,088.36

#### 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	1,128,893,107.57	91.57
	其中：普通股	1,055,516,165.58	85.62
	优先股	3,430,274.14	0.28
	存托凭证	69,946,667.85	5.67
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	286,172.82	0.02
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	286,172.82	0.02
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	75,596,784.31	6.13
8	其他各项资产	27,987,872.28	2.27
9	合计	1,232,763,936.98	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 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家(地区)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
美国	467,349,618.32	38.06
中国香港	413,722,446.69	33.69
韩国	34,984,086.43	2.85
新加坡	29,143,148.11	2.37

日本	25,637,638.51	2.09
德国	23,694,143.52	1.93
巴西	20,931,295.37	1.70
加拿大	17,469,598.61	1.42
印度	15,576,581.16	1.27
澳大利亚	14,247,499.37	1.16
印度尼西亚	13,208,420.23	1.08
英国	12,769,387.12	1.04
法国	12,475,595.41	1.02
西班牙	6,880,239.64	0.56
南非	5,749,443.55	0.47
马来西亚	4,074,037.97	0.33
瑞士	4,054,449.64	0.33
比利时	3,502,961.04	0.29
荷兰	3,422,516.88	0.28
合计	1,128,893,107.57	91.92

注：1、权益投资的国家类别根据其所在证券交易所确定；

2、由于四舍五入的原因市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 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
保健 Health Care	34,563,330.77	2.81
必需消费品 Consumer Staples	66,126,252.28	5.38
材料 Materials	148,692,599.90	12.11
电信服务 Telecommunication Services	22,196,227.35	1.81
非必需消费品 Consumer Discretionary	137,642,786.57	11.21
工业 Industrials	160,460,120.46	13.07
金融 Financials	219,313,116.98	17.86
能源 Energy	160,345,704.88	13.06
信息技术 Information Technology	179,552,968.38	14.62
合计	1,128,893,107.57	91.92

注：1、以上分类采用全球行业分类标准（GICS）；

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。

### 7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	HARBIN ELECTRIC INC	哈尔滨泰富电器	US41145W1099	纳斯达克证券交易所	美国	658,600	64,444,399.89	5.25
2	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	建设银行	CNE1000002H1	香港证券交易所	中国香港	9,000,000	48,275,541.00	3.93
3	CHINA SECURITY & SURVEILLANC	中国安防技术有限公司	US16942J1051	纽约证券交易所	美国	1,361,300	46,691,882.12	3.80
4	TENCENT HOLDINGS LTD	腾讯	KYG875721485	香港证券交易所	中国香港	180,000	31,614,865.92	2.57
5	BAIDU INC - SPON ADR	百度	US0567521085	纳斯达克证券交易所	美国	30,000	27,205,959.24	2.22
6	CNOOC LTD	中国海洋石油	HK0883013259	香港证券交易所	中国香港	1,700,000	25,673,772.64	2.09
7	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	海螺水泥	CNE1000001W2	香港证券交易所	中国香港	820,000	24,822,193.76	2.02
8	AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	农业银行	CNE100000Q43	香港证券交易所	中国香港	6,200,000	21,088,219.96	1.72
9	CHINA MOBILE LTD	中国移动	HK0941009539	香港证券交易所	中国香港	300,000	17,962,992.00	1.46
10	CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	中国神华	CNE1000002R0	香港证券交易所	中国香港	540,000	16,660,675.08	1.36
11	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	中国建材	CNE1000002N9	香港证券交易所	中国香港	1,046,000	13,274,285.18	1.08

12	CHINA PETROLEU M & CHEMICAL -H	中国石化	CNE10000 02Q2	香港证 券交易 所	中国香港	2,000,000	13,023,169. 20	1.06
13	NORFOLK SOUTHERN CORP	诺福克南 方	US655844 1084	纽约证 券交易 所	美国	25,000	12,122,924. 70	0.99
14	HYUNDAI MOBIS	现代精工	KR701233 0007	韩国证 券交易 所	韩国	4,800	11,637,606. 07	0.95
15	BBMG CORPORAT ION-H	金隅股份	CNE10000 0F20	香港证 券交易 所	中国香港	1,200,000	11,576,150. 40	0.94
16	PING AN INSURANC E GROUP CO-H	中国平安	CNE10000 03X6	香港证 券交易 所	中国香港	170,000	11,359,513. 39	0.92
17	PETROCHI NA CO LTD-H	中国石油 天然气	CNE10000 03W8	香港证 券交易 所	中国香港	1,200,000	11,356,602. 72	0.92
18	ICICI BANK LTD-SPON ADR	-	US45104G 1040	纽约证 券交易 所	美国	33,000	10,528,646. 04	0.86
19	KINROSS GOLD CORP	-	CA496902 4047	多伦多 证券交 易所	加拿大	99,000	10,091,720. 27	0.82
20	WEATHERF ORD INTL LTD	-	CH003883 8394	纽约证 券交易 所	美国	80,000	9,707,400.0 0	0.79
21	APACHE CORP	阿帕契	US037411 1054	纽约证 券交易 所	美国	11,600	9,262,956.4 0	0.75
22	HDFC BANK LTD-ADR	HDFC 银 行有限公 司	US40415F 1012	纽约证 券交易 所	美国	8,000	9,132,204.1 9	0.74
23	CHINA MERCHANT S BANK-H	招商银行	CNE10000 02M1	香港证 券交易 所	中国香港	560,000	8,755,295.3 6	0.71
24	MICROSOF T CORP	微软	US594918 1045	纳斯达 克证券 交易所	美国	51,883	8,729,916.5 9	0.71
25	EXPEDITO	华盛顿康	US302130	纳斯达	美国	25,000	8,282,030.1	0.67

	RS INTL WASH INC	捷国际物 流公司	1094	克证 券交 易所			0	
26	BELLE INTERNAT IONAL HOLDINGS	百丽	KYG09702 1045	香港证 券交 易所	中国香港	580,000	7,910,369.4 4	0.64
27	CELGENE CORP	-	US151020 1049	纳斯 达 克证 券交 易所	美国	20,000	7,807,338.2 4	0.64
28	KUNLUN ENERGY CO LTD	昆仑能源	BMG5320C 1082	香港证 券交 易所	中国香港	700,000	7,788,952.9 2	0.63
29	DOLLAR TREE INC	-	US256746 1080	纳斯 达 克证 券交 易所	美国	18,000	7,760,483.8 6	0.63
30	STRYKER CORP	史赛克	US863667 1013	纽约证 券交 易所	美国	20,000	7,596,364.0 8	0.62
31	EVERGRAN DE REAL ESTATE GROUP	恒大地产 集团	KYG3225A 1031	香港证 券交 易所	中国香港	1,800,000	7,589,364.1 2	0.62
32	CME GROUP INC	芝加哥商 业交易所 控股公司	US12572Q 1058	纳斯 达 克证 券交 易所	美国	4,000	7,548,215.3 8	0.61
33	TIANJIN ZHONG XIN PHARM CO-S	中新药业	CNE10000 0924	新加坡 证 券交 易所	新加坡	1,861,000	7,467,061.5 1	0.61
34	APPLE INC	苹果电脑	US037833 1005	纳斯 达 克证 券交 易所	美国	3,420	7,429,341.1 4	0.60
35	ALIMENTA TION COUCHE-T ARD -B	-	CA01626P 4033	多伦 多 证 券交 易所	加拿大	39,200	7,377,878.3 4	0.60
36	NOBLE GROUP LTD	来宝集团	BMG6542T 1190	新加坡 证 券交 易所	新加坡	709,090	7,357,552.9 3	0.60
37	INTIME DEPARTME NT STORE	银泰百货 商店	KYG49204 1036	香港证 券交 易所	中国香港	660,000	7,256,050.8 2	0.59
38	BHP BILLITON	必和必拓 有限公司	AU000000 BHP4	澳大利 亚证 券	澳大利亚	23,500	7,146,820.6 6	0.58

	LTD			交易所				
39	SUNNY OPTICAL TECH	舜宇光学 科技	KYG8586D 1097	香港证 券交易 所	中国香港	3,997,000	7,046,848.5 0	0.57
40	LIFESTYL E INTL HLDGS LTD	利福国际	KYG54856 1284	香港证 券交易 所	中国香港	370,000	6,984,776.3 8	0.57
41	HENGAN INTL GROUP CO LTD	恒安国际	KYG4402L 1510	香港证 券交易 所	中国香港	120,000	6,965,649.1 2	0.57
42	LOCALIZA RENT A CAR	-	BRRENTAC NOR4	圣保罗 证券交 易所	巴西	59,700	6,876,302.0 6	0.56
43	AJISEN CHINA HOLDINGS LTD	味千(中 国)	KYG0192S 1093	香港证 券交易 所	中国香港	500,000	6,702,857.2 0	0.55
44	BREADTAL K GROUP LTD	-	SG100291 0816	新加坡 证券交 易所	新加坡	2,101,200	6,640,250.3 1	0.54
45	AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	雅居乐集 团	KYG01198 1035	香港证 券交易 所	中国香港	660,000	6,619,362.5 5	0.54
46	FIRST TRACTOR CO-H	第一拖拉 机股份	CNE10000 0320	香港证 券交易 所	中国香港	820,000	6,601,066.9 1	0.54
47	STARBUCK S CORP	星巴克	US855244 1094	纳斯达 克证券 交易所	美国	25,500	6,516,868.8 4	0.53
48	SIEMENS AG-REG	西门子	DE000723 6101	德国证 券交易 所	德国	7,350	6,515,816.4 5	0.53
49	HARBIN POWER EQUIPMEN T CO-H	哈尔滨动 力股份	CNE10000 03CO	香港证 券交易 所	中国香港	880,000	6,498,611.3 3	0.53
50	BLACKSTO NE GROUP LP/THE	黑石集团	US09253U 1088	纽约证 券交易 所	美国	60,000	6,430,181.7 6	0.52
51	TINGYI (CAYMAN ISLN)	康师傅控 股	KYG8878S 1030	香港证 券交易 所	中国香港	320,000	6,400,147.5 2	0.52

	HLDG CO							
52	YANZHOU COAL MINING CO-H	兖州煤业	CNE10000 04Q8	香港证 券交易 所	中国香港	260,000	6,400,147.5 2	0.52
53	PETROFAC LTD	-	GB00B0H2 K534	伦敦证 券交易 所	英国	40,000	6,297,392.1 6	0.51
54	NATIONAL OILWELL VARCO INC	美国国民 油井	US637071 1011	纽约证 券交易 所	美国	12,200	6,174,954.8 0	0.50
55	ITAU UNIBANCO HLDNG-PR EF ADR	-	US465562 1062	纽约证 券交易 所	美国	40,000	6,096,247.2 0	0.50
56	ALPHA NATURAL RESOURCE S INC	阿尔法自 然资源股 份有限公 司	US02076X 1028	纽约证 券交易 所	美国	20,000	5,881,390.0 8	0.48
57	GILEAD SCIENCES INC	-	US375558 1036	纳斯达 克证券 交易所	美国	21,811	5,845,107.1 2	0.48
58	CONOCOPH ILLIPS	康菲石油	US20825C 1045	纽约证 券交易 所	美国	12,000	5,839,195.2 5	0.48
59	CHINA RESOURCE S ENTERPRI SE	华润创业	HK029100 1490	香港证 券交易 所	中国香港	220,000	5,818,013.5 2	0.47
60	INTERCON TINENTAL EXCHANGE INC	洲际交易 所公司 (ICE)	US45865V 1008	纽约证 券交易 所	美国	7,200	5,810,927.3 0	0.47
61	NIPPON ELECTRIC GLASS CO LTD	-	JP373340 0000	东京证 券交易 所	日本	70,000	5,763,052.2 6	0.47
62	BIDVEST GROUP LTD	-	ZAE00011 7321	约翰内 斯堡证 券交易 所	南非	39,949	5,749,443.5 5	0.47
63	HONGKONG LAND	香港置地 集团公司	BMG4587L 1090	新加坡 证券交	新加坡	120,000	5,529,335.0 4	0.45



	HOLDINGS LTD			易所				
64	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	三星电子有限公司	KR7005930003	韩国证券交易所	韩国	1,100	5,507,254.62	0.45
65	FAMILY DOLLAR STORES	家庭美元商店	US3070001090	纽约证券交易所	美国	16,122	5,483,854.71	0.45
66	DAELIM INDUSTRIAL CO LTD	大林工程有限公司	KR7000210005	韩国证券交易所	韩国	7,000	5,452,097.22	0.44
67	GENERAL ELECTRIC CO	通用电气	US3696041033	纽约证券交易所	美国	44,200	5,394,803.42	0.44
68	SINA CORP	新浪公司	KYG814771047	纳斯达克证券交易所	美国	8,000	5,389,548.48	0.44
69	WAL-MART STORES INC	沃尔玛百货	US9311421039	纽约证券交易所	美国	15,600	5,364,852.85	0.44
70	YUM! BRANDS INC	百胜全球餐饮	US9884981013	纽约证券交易所	美国	15,000	5,362,367.76	0.44
71	LG CHEM LTD	LG 化学有限公司	KR7051910008	韩国证券交易所	韩国	1,800	5,324,204.78	0.43
72	CHINA LIANSU GROUP HOLDINGS	中国联塑	KYG2159F1046	香港证券交易所	中国香港	1,000,000	5,280,787.00	0.43
73	DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-H	东方电气	CNE100000304	香港证券交易所	中国香港	220,000	5,278,292.14	0.43
74	ROYAL DUTCH SHELL PLC-ADR	荷兰皇家壳牌	US7802592060	纽约证券交易所	美国	11,300	5,201,671.46	0.42
75	XINYI GLASS HOLDINGS LTD	信义玻璃	KYG9828G1082	香港证券交易所	中国香港	800,000	5,129,432.16	0.42
76	DST	-	US233326	纽约证	美国	15,000	5,125,507.2	0.42

	SYSTEMS INC		1079	券交易 所			0	
77	COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	碧桂园	KYG24524 1032	香港证 券交易 所	中国香港	1,800,000	5,119,452.7 2	0.42
78	BALL CORP	波尔	US058498 1064	纽约证 券交易 所	美国	20,494	5,100,910.2 0	0.42
79	HYUNDAI DEPT STORE CO	韩国现代 百货商店	KR706996 0003	韩国证 券交易 所	韩国	4,828	5,077,257.2 0	0.41
80	UNION PACIFIC CORP	联合太平 洋	US907818 1081	纽约证 券交易 所	美国	7,500	5,067,262.8 0	0.41
81	ROSS STORES INC	Ross 商店 有限公司	US778296 1038	纳斯达 克证券 交易所	美国	9,700	5,029,494.5 4	0.41
82	LONGFOR PROPERTI ES	龙湖地产	KYG5635P 1090	香港证 券交易 所	中国香港	500,000	4,973,087.6 0	0.40
83	ANADARKO PETROLEU M CORP	阿纳达科 石油	US032511 1070	纽约证 券交易 所	美国	10,000	4,967,600.1 6	0.40
84	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	-	FR000012 1014	巴黎证 券交易 所	法国	4,259	4,947,786.4 3	0.40
85	GOLDEN EAGLE RETAIL GROUP	金鹰商贸 集团	KYG3958R 1092	香港证 券交易 所	中国香港	300,000	4,924,853.6 4	0.40
86	CHINA RESOURCE S CEMENT	华润水泥 控股	KYG2113L 1068	香港证 券交易 所	中国香港	800,000	4,869,966.7 2	0.40
87	CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	中信银行	CNE10000 01Q4	香港证 券交易 所	中国香港	1,200,000	4,840,028.4 0	0.39
88	BANK OF EAST ASIA	东亚银行	HK002300 0190	香港证 券交易 所	中国香港	180,100	4,785,303.6 5	0.39
89	ASAHI KASEI CORP	旭化成	JP311120 0006	东京证 券交易 所	日本	110,000	4,766,434.2 0	0.39

90	EXXON MOBIL CORP	艾克森美孚石油	US30231G 1022	纽约证 券交易 所	美国	9,000	4,739,929.2 7	0.39
91	MARVELL TECHNOLO GY GROUP LTD	Marvell 科技集团 有限公司	BMG5876H 1051	纳斯达 克证券 交易所	美国	49,348	4,715,358.0 3	0.38
92	OCCIDENT AL PETROLEU M CORP	西方石油	US674599 1058	纽约证 券交易 所	美国	7,000	4,713,136.8 5	0.38
93	ACCENTUR E PLC-CL A	-	IE00B4BN MY34	纽约证 券交易 所	美国	11,600	4,535,763.2 4	0.37
94	BUNGE LTD	-	BMG16962 1056	纽约证 券交易 所	美国	10,000	4,462,168.2 0	0.36
95	BOSIDENG INTL HLDGS LTD	波司登	KYG12652 1064	香港证 券交易 所	中国香港	2,200,000	4,390,953.6 0	0.36
96	VINDA INTERNAT IONAL HOLDINGS	维达纸业	KYG9361V 1086	香港证 券交易 所	中国香港	600,000	4,361,015.2 8	0.36
97	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P	-	ID100005 7003	印尼证 券交易 所	印度尼西亚	1,000,000	4,335,512.0 6	0.35
98	AMERICAN TOWER CORP-CL A	美国发射 塔公司	US029912 2012	纽约证 券交易 所	美国	12,500	4,233,235.3 5	0.34
99	AXIS BANK LTD	-	INE238A0 1026	印度证 券交易 所	印度	22,605	4,218,682.5 6	0.34
100	CREDIT AGRICOLE SA	法国农业 信贷银行	FR000004 5072	巴黎证 券交易 所	法国	43,000	4,174,252.6 9	0.34
101	FREEPORT -MCMORAN COPPER	自由港迈 克墨伦	US35671D 8570	纽约证 券交易 所	美国	12,000	4,108,171.6 8	0.33
102	QSR BRANDS BHD	-	MYL94150 0000	吉隆坡 证券交 易所	马来西亚	325,200	4,074,037.9 7	0.33
103	MAHINDRA	-	INE101A0	印度证	印度	40,000	4,063,211.0	0.33

	& MAHINDRA LTD		1026	券交易 所			8	
104	NESTLE SA-REG	雀巢	CH003886 3350	瑞士证 券交易 所	瑞士	10,000	4,054,449.6 4	0.33
105	GEA GROUP AG	基伊埃集 团股份公 司	DE000660 2006	德国证 券交易 所	德国	17,464	4,035,602.4 6	0.33
106	SESA GOA LTD	-	INE205A0 1025	印度证 券交易 所	印度	97,500	3,979,833.2 0	0.32
107	FORD MOTOR CO	福特汽车	US345370 8600	纽约证 券交易 所	美国	43,900	3,917,783.6 8	0.32
108	INTL BUSINESS MACHINES CORP	国际商业 机器	US459200 1014	纽约证 券交易 所	美国	3,500	3,885,710.4 3	0.32
109	DEVON ENERGY CORPORAT ION	戴文能源	US25179M 1036	纽约证 券交易 所	美国	7,600	3,876,203.6 5	0.32
110	TIANGONG INTL CO LTD	天工国际	KYG88831 1134	香港证 券交易 所	中国香港	2,708,000	3,850,966.1 0	0.31
111	QIHOO 360 TECHNOLO GY CO-ADR	-	US74734M 1099	纽约证 券交易 所	美国	30,000	3,768,412.6 8	0.31
112	MRV ENGENHAR IA	-	BRMRVEAC NOR2	圣保罗 证券交 易所	巴西	70,000	3,745,238.2 8	0.30
113	SEGA SAMMY HOLDINGS INC	-	JP341905 0004	东京证 券交易 所	日本	30,000	3,728,892.2 1	0.30
114	BANK RAKYAT INDONESI A PERSER	-	ID100011 8201	印尼证 券交易 所	印度尼西 亚	750,000	3,675,760.2 2	0.30
115	SOUTHERN COPPER CORP	南方铜业 公司	US84265V 1052	纽约证 券交易 所	美国	17,000	3,616,265.3 6	0.29
116	BANCO	-	ES011390	西班牙	西班牙	47,667	3,553,252.4	0.29

	SANTANDE R SA		0J37	证券交 易所			0	
117	NGK SPARK PLUG CO LTD	桑坦德	JP373860 0000	东京证 券交易 所	日本	40,000	3,553,160.0 4	0.29
118	MONSANTO CO	孟山都	US61166W 1018	纽约证 券交易 所	美国	7,500	3,520,873.9 8	0.29
119	AGEAS	-	BE000380 1181	布鲁塞 尔证券 交易所	比利时	200,000	3,502,961.0 4	0.29
120	HARRIS CORP	哈里斯公 司	US413875 1056	纽约证 券交易 所	美国	12,000	3,499,323.5 5	0.28
121	WACKER CHEMIE AG	瓦克化学 股份公司	DE000WCH 8881	德国证 券交易 所	德国	2,500	3,489,387.3 0	0.28
122	SOUTHWES TERN ENERGY CO	西南能源 公司	US845467 1095	纽约证 券交易 所	美国	12,500	3,468,777.6 0	0.28
123	BANCO DO BRASIL S. A.	巴西银行 股份公司	BRBBASAC NOR3	圣保罗 证券交 易所	巴西	30,000	3,467,813.2 2	0.28
124	ITAUSA-I NVESTIME NTOS ITAU-PR	-	BRITSAAC NPR7	圣保罗 证券交 易所	巴西	69,300	3,430,274.1 4	0.28
125	HEINEKEN HOLDING NV	荷兰喜力 控股公司	NL000000 8977	阿姆斯特 丹证 券交易 所	荷兰	10,363	3,422,516.8 8	0.28
126	MGM RESORTS INTERNAT IONAL	美高梅国 际酒店集 团	US552953 1015	纽约证 券交易 所	美国	40,000	3,419,593.4 4	0.28
127	BM&FBOVE SPA SA	-	BRBVMFAC NOR3	圣保罗 证券交 易所	巴西	80,000	3,411,667.6 7	0.28
128	ACE LTD	-	CH004432 8745	纽约证 券交易 所	美国	8,000	3,407,685.7 0	0.28
129	SAIC INC	-	US78390X 1019	纽约证 券交易 所	美国	31,300	3,407,077.3 7	0.28

130	FRESENIUS SE & CO KGAA	费森尤斯集团	DE0005785604	德国证券交易所	德国	5,000	3,369,095.88	0.27
131	LOREAL	欧莱雅	FR0000120321	巴黎证券交易所	法国	4,000	3,353,556.29	0.27
132	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	西班牙对外银行	ES0113211835	西班牙证券交易所	西班牙	43,931	3,326,987.24	0.27
133	UNITED PHOSPHORUS LTD	联合磷业有限公司	INE628A01036	印度证券交易所	印度	150,000	3,314,854.32	0.27
134	CLIFFS NATURAL RESOURCES INC	克里夫斯自然资源股份有限公司	US18683K1016	纽约证券交易所	美国	5,500	3,290,646.81	0.27
135	ICAP PLC	毅联汇业集团	GB0033872168	伦敦证券交易所	英国	66,255	3,258,777.22	0.27
136	ROSNEFT OJSC-REGS GDR	俄罗斯石油公司	US67812M2070	伦敦国际证券交易所	英国	58,968	3,213,217.74	0.26
137	BASF SE	巴斯夫欧洲公司	DE000BAS F111	德国证券交易所	德国	5,000	3,162,681.42	0.26
138	TRANSOCEAN LTD	-	CH0048265513	纽约证券交易所	美国	7,563	3,159,870.53	0.26
139	EBAY INC	电子湾	US2786421030	纳斯达克证券交易所	美国	15,000	3,132,577.98	0.26
140	SAP AG	-	DE0007164600	德国证券交易所	德国	7,987	3,121,560.01	0.25
141	EMBRY HOLDINGS LTD	安莉芳	KYG3066H1002	香港证券交易所	中国香港	646,000	2,954,745.86	0.24
142	POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	萨斯喀彻温省钾肥股份有限公司	CA73755L1076	纽约证券交易所	美国	8,000	2,950,531.87	0.24
143	NITTO DENKO	-	JP3684000007	东京证券交易所	日本	9,000	2,935,690.16	0.24

	CORP			所				
144	CF INDUSTRI ES HOLDINGS INC	CF 工业控 股股份有 限公司	US125269 1001	纽约证 券交易 所	美国	3,200	2,933,861.0 3	0.24
145	NEWMONT MINING CORP	纽蒙特矿 业	US651639 1066	纽约证 券交易 所	美国	8,000	2,794,178.0 2	0.23
146	BERKSHIR E HATHAWAY INC-CL B	-	US084670 7026	纽约证 券交易 所	美国	5,500	2,754,604.1 8	0.22
147	OZ MINERALS LTD	OZ 矿产 有限公司	AU000000 OZL8	澳大利 亚证券 交易所	澳大利亚	30,000	2,749,578.3 4	0.22
148	JPMORGAN CHASE & CO	摩根大通	US46625H 1005	纽约证 券交易 所	美国	10,000	2,649,473.0 4	0.22
149	JGC CORP	日挥株式 会社	JP366760 0005	东京证 券交易 所	日本	15,000	2,642,000.7 8	0.22
150	ASTRA INTERNAT IONAL TBK PT	-	ID100005 7607	印尼证 券交易 所	印度尼西 亚	55,000	2,635,425.8 3	0.21
151	VALE SA-SP ADR	淡水河谷 公司	US91912E 1055	纽约证 券交易 所	美国	12,000	2,481,211.4 4	0.20
152	WATERS CORP	活德	US941848 1035	纽约证 券交易 所	美国	4,000	2,478,363.9 4	0.20
153	MECHEL-S PONSORED ADR	-	US583840 1033	纽约证 券交易 所	美国	15,000	2,319,097.8 6	0.19
154	NOVARISE RENEWABL E RESOURCE S	-	AU000000 NOE9	澳大利 亚证券 交易所	澳大利亚	1,477,157	2,256,421.6 0	0.18
155	KOITO MANUFACT URING CO LTD	-	JP328460 0008	东京证 券交易 所	日本	20,000	2,248,408.8 6	0.18

156	OLAM INTERNAT IONAL LTD	奥兰国际 有限公司	SG1Q7592 3504	新加坡 证券交 易所	新加坡	150,000	2,148,948.3 2	0.17
157	NEWCREST MINING LTD	纽克雷斯 特矿业有 限公司	AU000000 NCM7	澳大利 亚证券 交易所	澳大利 亚	8,000	2,094,678.7 7	0.17
158	CISCO SYSTEMS INC	思科	US17275R 1023	纳斯达 克证券 交易所	美国	20,000	2,020,433.5 2	0.16
159	KOREA ZINC CO LTD	高丽亚铅 公司	KR701013 0003	韩国证 券交易 所	韩国	800	1,985,666.5 4	0.16
160	MOLYCORP INC	-	US608753 1090	纽约证 券交易 所	美国	5,000	1,975,779.4 8	0.16
161	BARRICK GOLD CORP	-	CA067901 1084	纽约证 券交易 所	美国	6,515	1,909,538.4 5	0.16
162	GOOGLE INC-CL A	谷歌公司	US38259P 5089	纳斯达 克证券 交易所	美国	500	1,638,544.4 0	0.13
163	CSX CORP	-	US126408 1035	纽约证 券交易 所	美国	9,000	1,527,168.1 7	0.12
164	MURPHY OIL CORP	墨菲石油 公司	US626717 1022	纽约证 券交易 所	美国	3,500	1,487,238.4 0	0.12
165	HESS CORP	阿美拉达 赫斯	US42809H 1077	纽约证 券交易 所	美国	3,000	1,451,450.4 5	0.12
166	LAM RESEARCH CORP	-	US512807 1082	纳斯达 克证券 交易所	美国	5,000	1,432,812.2 4	0.12
167	MAYORA INDAH PT	-	ID100006 0007	印尼证 券交易 所	印度尼 西 亚	145,000	1,421,293.9 5	0.12
168	DEERE & CO	迪尔	US244199 1054	纽约证 券交易 所	美国	2,500	1,333,958.5 5	0.11
169	ACE HARDWARE INDONESI A	-	ID100010 8004	印尼证 券交易 所	印度尼 西 亚	500,000	1,140,428.1 7	0.09
170	ZTE	中兴通讯	CNE10000	香港证	中国香港	40,000	938,067.36	0.08



	CORP-H		04Y2	券交易 所				
--	--------	--	------	----------	--	--	--	--

注：上表所用证券代码采用 ISIN 代码。

## 7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

### 7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	HARBIN ELECTRIC INC	US41145W1099	58,320,646.08	3.78
2	CHINA SECURITY & SURVEILLANC	US16942J1051	44,134,772.29	2.86
3	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	CNE1000001W2	22,843,077.89	1.48
4	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	CNE1000002Q2	20,802,414.22	1.35
5	CHINA MOBILE LTD	HK0941009539	18,001,842.60	1.17
6	AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	CNE100000Q43	17,482,277.25	1.13
7	ICICI BANK LTD-SPON ADR	US45104G1040	13,841,492.57	0.90
8	PETROCHINA CO LTD-H	CNE1000003W8	13,727,649.51	0.89
9	BBMG CORPORATION-H	CNE100000F20	12,622,109.55	0.82
10	HDFC BANK LTD-ADR	US40415F1012	12,580,857.15	0.82
11	AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	KYG011981035	12,459,941.20	0.81
12	CNOOC LTD	HK0883013259	12,223,375.16	0.79
13	NORFOLK SOUTHERN CORP	US6558441084	11,736,595.08	0.76
14	HYUNDAI MOBIS	KR7012330007	11,012,332.39	0.71
15	WEATHERFORD INTL LTD	CH0038838394	10,924,502.60	0.71
16	DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-H	CNE100000304	10,850,797.38	0.70
17	LONGFOR PROPERTIES	KYG5635P1090	10,775,696.48	0.70
18	DAELIM INDUSTRIAL CO LTD	KR7000210005	10,406,721.99	0.68
19	SINO-OCEAN LAND HOLDINGS	HK3377040226	10,099,622.64	0.66
20	INTESA SANPAOLO	IT0000072618	9,635,597.03	0.63

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。

### 7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	PETROCHINA CO LTD-H	CNE1000003 W8	28,198,603.75	1.83
2	CHINA LIFE INSURANCE CO-H	CNE1000002L 3	24,497,428.42	1.59
3	HYUNDAI MOBIS	KR7012330007	20,337,858.73	1.32
4	CNOOC LTD	HK088301325 9	20,032,449.97	1.30
5	CHINA UNICOM HONG KONG LTD	HK000004993 9	19,162,011.78	1.24
6	ZHUZHOU CSR TIMES ELECTRIC-H	CNE1000004X 4	16,765,629.99	1.09
7	CHINA STATE CONSTRUCTION INT	KYG21677136 3	15,087,208.60	0.98
8	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	CNE1000002H 1	13,617,572.51	0.88
9	GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	CNE10000033 8	13,381,654.48	0.87
10	HDFC BANK LTD-ADR	US40415F1012	13,352,691.78	0.87
11	ICICI BANK LTD-SPON ADR	US45104G104 0	12,633,213.40	0.82
12	HIDILI INDUSTRY INTL DEVELOP	KYG44403106 9	12,049,555.63	0.78
13	CHINA COAL ENERGY CO-H	CNE10000052 8	11,848,471.99	0.77
14	CHINA YURUN FOOD GROUP LTD	BMG21159101 8	11,786,815.97	0.76
15	CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	CNE1000009Q 7	11,734,182.03	0.76
16	GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	CNE10000056 9	11,455,284.30	0.74
17	CHANGSHA ZOOMLION HEAVY IN-H	CNE100000X8 5	11,383,839.39	0.74
18	SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	KYG81043104 2	10,627,847.00	0.69
19	SANDS CHINA LTD	KYG7800X107 9	10,437,759.81	0.68
20	HARBIN ELECTRIC INC	US41145W109 9	10,376,976.28	0.67

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。

**7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额**

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	1,052,620,387.69
卖出收入（成交）总额	1,362,038,065.72

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。

**7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合**

本基金本报告期末未持有债券。

**7.7 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**

本基金本报告期末未持有债券。

**7.8 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。

**7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细**

金额单位：人民币元

序号	衍生品类别	衍生品名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	权证投资	CHINA CITIC BANK CORP LTD-RIGHT	167,654.59	0.01
2	权证投资	SANOFI CVR	118,518.23	0.01

**7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细**

本基金本报告期末未持有基金。

**7.11 投资组合报告附注**

**7.11.1** 本基金投资的前十名证券的发行主体本期末没有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。

**7.11.2** 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。

**7.11.3 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	-
2	应收证券清算款	24,257,603.92

3	应收股利	3,626,065.34
4	应收利息	18,291.73
5	应收申购款	85,911.29
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	27,987,872.28

#### 7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

## § 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

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
67,502	18,334.19	62,005,922.81	5.01%	1,175,588,886.22	94.99%

### 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	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	293,392.54	0.02%

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2008 年 2 月 14 日) 基金份额总额	3,155,816,636.00
本报告期期初基金份额总额	1,537,686,135.05
本报告期基金总申购份额	31,117,480.79

减：本报告期基金总赎回份额	331,208,806.81
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,237,594,809.03

## § 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基金份额持有人大会。

### 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：

本报告期内，根据证监会《关于核准中国银行股份有限公司李爱华基金行业高级管理人员任职资格的批复》，李爱华先生担任本基金托管人——中国银行托管及投资者服务部总经理；因工作调动，董杰先生不再担任中国银行托管及投资者服务部总经理。该人事变动已按相关规定备案并公告。

### 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

本报告期内，本基金未改聘为其审计的会计师事务所。

### 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	
CREDIT SUISSE Securities	-	985,552,744.29	40.90%	372,540.40	19.02%	-
Goldman Sachs	-	521,074,030.23	21.63%	395,713.23	20.20%	-
Morgan Stanley	-	197,505,028.10	8.20%	251,117.66	12.82%	新增
Nomura international	-	177,506,928.84	7.37%	316,008.57	16.13%	-
BNP Paribas	-	133,747,379.05	5.55%	160,496.82	8.19%	-
J.P. Morgan	-	132,016,925.37	5.48%	125,732.01	6.42%	-
Merrill Lynch	-	113,111,919.14	4.69%	161,076.64	8.22%	-
CICC	-	87,798,640.74	3.64%	109,748.31	5.60%	-
UBS Securities	-	34,441,479.54	1.43%	34,441.49	1.76%	-
CLSA Ltd.	-	26,708,140.07	1.11%	32,049.78	1.64%	-
China Merchants Securities	-	-	-	-	-	-
Deutsche Bank	-	-	-	-	-	-
Citigroup	-	-	-	-	-	-

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	权证交易		股指期货交易	
	成交金额	占当期权证 成交总额的比例	成交金额	占当期股指期货 成交总额的比例
Credit Suisse	75,592.47	100%	-	-
Goldman Sachs	-	-	66,725,978.97	100%
Morgan Stanley	-	-	-	-
Nomura international	-	-	-	-
BNP Paribas	-	-	-	-
J.P. Morgan	-	-	-	-
Merrill Lynch	-	-	-	-
CICC	-	-	-	-

UBS Securities	-	-	-	-
CLSA Ltd.	-	-	-	-
UBS Securities	-	-	-	-
CLSA Ltd.	-	-	-	-
China Merchants Securities	-	-	-	-
Deutsche Bank	-	-	-	-
Citigroup	-	-	-	-

## 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	工银瑞信中国机会全球配置股票型证券投资基金 2010 年第 4 季度报告	三大报、公司网站	2011 年 1 月 24 日
2	工银瑞信中国机会全球配置股票型证券投资基金 2010 年度报告	三大报、公司网站	2011 年 3 月 26 日
3	工银瑞信中国机会全球配置股票型证券投资基金 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、证券时报、上海证券报。

## § 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

- 12.1.1 中国证监会批准工银瑞信中国机会全球配置股票型证券投资基金募集的文件
- 12.1.2 《工银瑞信中国机会全球配置股票型证券投资基金基金合同》
- 12.1.3 《工银瑞信中国机会全球配置股票型证券投资基金托管协议》
- 12.1.4 《工银瑞信中国机会全球配置股票型证券投资基金招募说明书》
- 12.1.5 基金管理人业务资格批件、营业执照
- 12.1.6 基金托管人业务资格批件、营业执照
- 12.1.7 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住所。

## 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](http://www.icbccs.com.cn)