

# 工银瑞信全球精选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 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

§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 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
§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
§4 管理人报告.....	8
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.....	9
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.....	10
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.....	11
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
§5 托管人报告.....	12
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真实、准确和完整发表意见.....	12
§6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	13
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
§7 投资组合报告.....	34
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.....	44
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	45
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.....	46
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.....	46
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.....	46
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.....	46
7.11 投资组合报告附注.....	46

§8 基金份额持有人信息.....	47
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	47
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.....	47
§9 开放式基金份额变动.....	47
§10 重大事件揭示.....	47
10.1 基金份额持有人大会决议.....	47
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.....	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	48
10.4 基金投资策略的改变.....	48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	48
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.....	48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	48
10.8 其他重大事件.....	50
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	50
§12 备查文件目录.....	51
12.1 备查文件目录.....	51
12.2 存放地点.....	51
12.3 查阅方式.....	51

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	工银瑞信全球精选股票型证券投资基金
基金简称	工银全球精选股票(QDII)
基金主代码	486002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年5月25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	134,138,979.01份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	全球范围内具有竞争优势且成长性良好的上市公司。
投资策略	通过在全球范围内采用“自上而下”方法进行国家及地区的资产配置，综合运用定性和定量分析方法精选全球股票，并且在全球范围内进行投资组合风险收益优化，追求基金资产的长期稳健增值。
业绩比较基准	MSCI 世界指数总收益。
风险收益特征	本基金是投资于全球资本市场的股票型基金，属于风险水平较高的基金品种，其预期收益及风险水平高于债券型基金，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 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	-	The Bank of New York Mellon Corporation
	中文	-	纽约梅隆银行股份有限公司
注册地址		-	One Wall Street, New York
办公地址		-	One Wall Street, New York
邮政编码		-	NY 10286

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办公场所

## 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	8,271,770.19
本期利润	-2,680,063.98
加权平均基金份额本期利润	-0.0165
本期加权平均净值利润率	-1.57%
本期基金份额净值增长率	-1.21%
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	7,622,668.52
期末可供分配基金份额利润	0.0568
期末基金资产净值	141,761,647.53
期末基金份额净值	1.057

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	5.70%

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、本期已实现收益是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、期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数；

4、本基金基金合同生效日为 2010 年 5 月 25 日。

## 3.2 基金净值表现

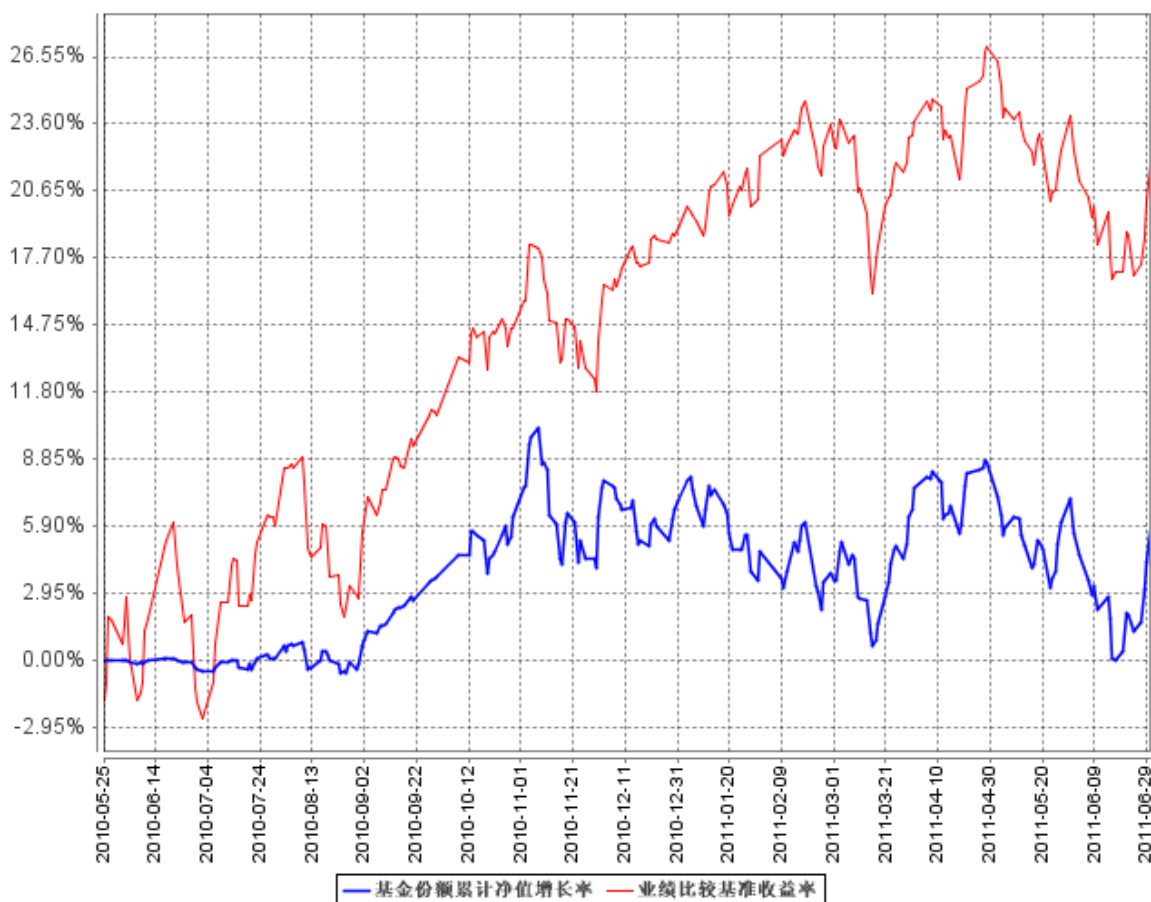
### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-1.31%	1.04%	-1.77%	1.08%	0.46%	-0.04%
过去三个月	-0.84%	0.85%	-1.05%	0.88%	0.21%	-0.03%
过去六个月	-1.21%	0.83%	2.29%	0.83%	-3.50%	0.00%
过去一年	6.12%	0.72%	24.02%	0.87%	-17.90%	-0.15%
自基金合同生效起至今	5.70%	0.69%	21.76%	0.96%	-16.06%	-0.27%

注：本基金基金合同生效日为 2010 年 5 月 25 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 2010 年 5 月 25 日生效，按照基金合同规定，本基金自基金合同生效日起 6 个月内为建仓期。截至报告期末，本基金投资符合基金合同第十二部分“（二）投资范围”、“（六）投资限制”的规定。

## § 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		
游凇峰	本基金的基金经理；工银全球基金基金经理	2010 年 5 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：游凇峰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 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。

### 4.4 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

今年上半年全球市场走势如下：行业方面，非周期性行业（医疗，日常消费，及电讯）上涨幅度都超过 7%，其中涨幅最多的行业是医疗，涨幅 13.3%。周期性行业中金融，科技，材料虽都有正收益但涨幅均低于 2%。不同的国家与地区收益率分化更大：欧美主要市场指数（美国标普 500 及摩根斯坦利欧洲综合指数）涨幅都超过 6%，新兴市场中印度及巴西都是负收益，其中印度跌幅为-8.6%。

新兴市场与抗通胀主题是本基金的三大长期投资策略中的两个，上半年市场偏防守的氛围使

得本基金在新兴市场及资源类中有较大的负的相对收益率。尽管如此，因为个股选择原因，本基金在基础工业行业及韩国有较大的正的收益率。

本基金长期投资策略仍然是由三个部分组成，抗通胀机会，发达市场高质量企业超跌机会及新兴市场长期增长机会。尽管如此，本基金意识到当前市场上的避险情绪，在新兴市场及资源类投资方面基本上采用谨慎持有与波段操作的方法。

#### 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-1.21%，业绩比较基准增长率为 2.29%。

#### 4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

虽然上半年总体全球股指走势偏防守，但从走势的轨迹来看，一二月份新兴市场及资源类大幅跑输大盘指数。因为受益于巴菲特的韩国及印度的访问，三月份新兴市场（特别是印度）大幅反弹；四五月份新兴市场及资源类又是相对跑输大盘指数，六月份略微跑赢。今年一整年预期是在新兴市场及资源类与发达市场及防御类两个投资主题之间的拉锯。

另外，第二季度末发生了两件重大事件。一是国际能源组织释放了 6 千万桶原油，二是美联储出面表示在量化宽松二（QE2）结束后，它会用到期债券的资金继续买入国债。两者的含义是，在六月底 QE2 的货币政策结束后，美国政府会用不同的市场干预方式来抑制量化宽松所带来的后遗症（通胀）。同时，在 QE2 结束后，因为美国经济复苏力度大大低于预期，不同形式的量化宽松将会继续。

这种大环境对于本基金的抗通胀主题是极为有利的。尽管如此，在执行此策略的同时，基金会参照历史上政府干预大宗商品市场对此市场短期所带来的风险而进行谨慎投资。同时当通胀仍然是市场担忧时，基金会特别注重投资新兴市场的风险。

#### 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

本报告期内，本基金未实施利润分配。

## § 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，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，本基金未实施利润分配。

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、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：工银瑞信全球精选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	5,763,083.05	24,897,502.49
结算备付金		-	-
存出保证金		-	910,731.52
交易性金融资产	6.4.7.2	134,060,474.49	195,911,509.63
其中：股票投资		134,060,474.49	195,911,509.63
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	24,449.63	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		3,608,764.42	501,219.00
应收利息	6.4.7.5	544.18	1,750.24
应收股利		206,329.74	56,853.45
应收申购款		12,989.44	163,500.94
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	224,532.87	-
资产总计		143,901,167.82	222,443,067.27
<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		332,028.26	445,141.34
应付赎回款		1,009,720.21	2,289,836.24
应付管理人报酬		205,804.28	340,134.27
应付托管费		40,017.52	66,137.23
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	551,950.02	232,629.55
负债合计		2,139,520.29	3,373,878.63
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	134,138,979.01	204,745,354.26
未分配利润	6.4.7.10	7,622,668.52	14,323,834.38
所有者权益合计		141,761,647.53	219,069,188.64
负债和所有者权益总计		143,901,167.82	222,443,067.27

注：报告截止日 2011 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.057 元，基金份额总额 134,138,979.01 份。

## 6.2 利润表

会计主体：工银瑞信全球精选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 5 月 25 日至 2010 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		-331,588.24	-897,595.87
1. 利息收入		18,396.33	468,376.01
其中：存款利息收入	6.4.7.11	18,396.33	468,376.01
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）		11,061,034.02	-144,450.34
其中：股票投资收益	6.4.7.12	9,544,378.67	-177,530.60
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	152,496.49	-
股利收益	6.4.7.16	1,364,158.86	33,080.26
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-10,951,834.17	-1,115,982.94
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-556,716.91	-134,304.01
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	97,532.49	28,765.41
<b>减：二、费用</b>		2,348,475.74	1,294,252.47
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,526,139.33	1,039,618.61
2. 托管费	6.4.10.2.2	296,749.36	202,148.04
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	345,080.48	14,984.10
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	180,506.57	37,501.72

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-2,680,063.98	-2,191,848.34
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-2,680,063.98	-2,191,848.34

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：工银瑞信全球精选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)	204,745,354.26	14,323,834.38	219,069,188.64
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	-2,680,063.98	-2,680,063.98
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)	-70,606,375.25	-4,021,101.88	-74,627,477.13
其中：1. 基金申购款	5,055,412.50	254,217.57	5,309,630.07
2. 基金赎回款	-75,661,787.75	-4,275,319.45	-79,937,107.20
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)	134,138,979.01	7,622,668.52	141,761,647.53
项目	上年度可比期间 2010 年 5 月 25 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)	585,845,814.67	-	585,845,814.67
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	-2,191,848.34	-2,191,848.34
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)	-23,025,147.84	64,238.43	-22,960,909.41
其中：1. 基金申购款	48,723.66	-82.33	48,641.33
2. 基金赎回款	-23,073,871.50	64,320.76	-23,009,550.74

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)	562,820,666.83	-2,127,609.91	560,693,056.92

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

工银瑞信全球精选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[2010]178 号文《关于同意工银瑞信全球精选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于 2010 年 4 月 15 日至 2010 年 5 月 17 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（2010）验字第 60802052\_A04 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。《工银瑞信全球精选股票型证券投资基金基金合同》于 2010 年 5 月 25 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 585,793,336.29 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 52,478.38 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 585,845,814.67 元，折合 585,845,814.67 份基金份额。本基金的基金管理人和注册登记机构均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，境外资产托管人为纽约梅隆银行股份有限公司。

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《工银瑞信全球精选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：国际资本市场股票、债券、回购、股票指数期货、外汇远期合约、外汇互换及其它用于组合避险或有效管理的金融衍生工具。其中，股票资产占基金资产的比例为 60%-95%，债券、现金等金融工具占基金资产的比例为 5%-40%，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 MSCI 世界指数总收益。



#### 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 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日止会计期间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》及其他境内外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在境内暂免征收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	5,763,083.05
定期存款	-
其他存款	-
合计：	5,763,083.05

## 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	130,380,703.04	134,060,474.49	3,679,771.45
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	130,380,703.04	134,060,474.49	3,679,771.45

## 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	-	24,449.63	-	
权证	-	24,449.63	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	-	24,449.63	-	

**6.4.7.4 买入返售金融资产**

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

**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	544.18
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	544.18

**6.4.7.6 其他资产**

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
其他应收款	224,532.87
待摊费用	-
合计	224,532.87

**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	2,336.77
其他应付款	226,845.73
预提费用	322,767.52
合计	551,950.02

## 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	204,745,354.26	204,745,354.26
本期申购	5,055,412.50	5,055,412.50
本期赎回(以“-”号填列)	-75,661,787.75	-75,661,787.75
本期末	134,138,979.01	134,138,979.01

## 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	10,642,794.72	3,681,039.66	14,323,834.38
本期利润	8,271,770.19	-10,951,834.17	-2,680,063.98
本期基金份额交易产生的变动数	-5,659,336.56	1,638,234.68	-4,021,101.88
其中：基金申购款	406,117.47	-151,899.90	254,217.57
基金赎回款	-6,065,454.03	1,790,134.58	-4,275,319.45
本期已分配利润	-	-	-
本期末	13,255,228.35	-5,632,559.83	7,622,668.52

## 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
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	105.02
合计	18,396.33

**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	232,155,160.02
减：卖出股票成本总额	222,610,781.35
买卖股票差价收入	9,544,378.67

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——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	152,496.49
减：卖出权证成本总额	-
买卖权证差价收入	152,496.49

注：“买卖权证差价收入”包含权证行权产生的差价收入。

**6.4.7.16 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	1,364,158.86
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,364,158.86

## 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	-10,976,283.80
——股票投资	-10,976,283.80
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
2. 衍生工具	24,449.63
——权证投资	24,449.63
3. 其他	-
合计	-10,951,834.17

## 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	97,532.49
合计	97,532.49

## 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	345,080.48
银行间市场交易费用	-
合计	345,080.48

## 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	29,752.78
信息披露费	119,014.74
税费	26,811.68
银行费用	3,075.74
其他	1,851.63
合计	180,506.57

#### 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
美国	-461,697.01
中国香港	-1,316,315.31
韩国	2,381,366.93
欧元区	1,380,360.38
巴西	-819,211.47
印度尼西亚	575,907.99
其他	-2,071,999.75
合计	-331,588.24

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
瑞士信贷	基金管理人股东

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

## 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5月25日(基金合同生效日)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	332,210,622.39	82.26%	-	-

## 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5月25日(基金合同生效日)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	30,409.36	100.00%	-	-

## 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	144,654.23	83.18%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2010年5月25日(基金合同生效日)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
-	-	-	-	-

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5月25日(基金合同生效日) 至2010年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,526,139.33	1,039,618.61
其中：支付销售机构的客户维护费	650,958.63	427,414.96

注：1、基金管理费按前一估值日的基金资产净值的 1.80% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.80\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一估值日的基金资产净值

2、基金管理人的管理费每日计算，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5月25日(基金合同生效日) 至2010年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	296,749.36	202,148.04

注：1、基金托管费按前一估值日的基金资产净值的 0.35% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.35\% / \text{当年天数}$$

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、基金托管费每日计算，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与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5月25日(基金合同生效日)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	2,314,945.95	18,266.53	531,556,279.38	468,376.01

**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**

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	5,763,083.05	-	-	-	-	-	5,763,083.05
结算备付金	-	-	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	-	-	134,060,474.49	134,060,474.49
衍生金融资产	-	-	-	-	-	24,449.63	24,449.63
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	3,608,764.42	3,608,764.42

应收利息	-	-	-	-	-	544.18	544.18
应收股利	-	-	-	-	-	206,329.74	206,329.74
应收申购款	1,638.49	-	-	-	-	11,350.95	12,989.44
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	224,532.87	224,532.87
资产总计	5,764,721.54	-	-	-	-	138,136,446.28	143,901,167.82
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	-	-	-	-	-	332,028.26	332,028.26
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,009,720.21	1,009,720.21
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	205,804.28	205,804.28
应付托管费	-	-	-	-	-	40,017.52	40,017.52
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	-	-	-	-	-	551,950.02	551,950.02
负债总计	-	-	-	-	-	2,139,520.29	2,139,520.29
利率敏感度缺口	5,764,721.54	-	-	-	-	-135,996,925.99	141,761,647.53
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	24,897,502.49	-	-	-	-	-	24,897,502.49
结算备付金	-	-	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-	910,731.52	910,731.52
交易性金融资产	-	-	-	-	-	195,911,509.63	195,911,509.63
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	501,219.00	501,219.00
应收利息	-	-	-	-	-	1,750.24	1,750.24
应收股利	-	-	-	-	-	56,853.45	56,853.45
应收申购款	-	-	-	-	-	163,500.94	163,500.94
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	24,897,502.49	-	-	-	-	197,545,564.78	222,443,067.27

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	-	-	-	-	-	445,141.34	445,141.34
应付赎回款	-	-	-	-	-	2,289,836.24	2,289,836.24
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	340,134.27	340,134.27
应付托管费	-	-	-	-	-	66,137.23	66,137.23
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	-	-	-	-	-	232,629.55	232,629.55
负债总计	-	-	-	-	-	3,373,878.63	3,373,878.63
利率敏感度缺口	24,897,502.49	-	-	-	-	-194,171,686.15	219,069,188.64

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 2010 年 12 月 31 日和 2011 年 6 月 30 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						
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	巴西雷亚尔 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
以外币计价的资产							

银行存款	1,198,193.25	20,156.46	0.08	57.29	-	2,230,214.03	3,448,621.11
交易性金融资产	74,800,334.32	16,523,374.63	7,919,959.27	7,281,474.33	7,268,711.64	20,266,620.30	134,060,474.49
衍生金融资产	-	24,449.63	-	-	-	-	24,449.63
应收证券清算款	2,196,685.28	-	-	-	952,108.61	459,970.53	3,608,764.42
应收利息	7.64	-	-	-	-	-	7.64
应收股利	74,647.77	-	20,235.90	-	-	8,081.07	102,964.74
其它应收款	224,532.87	-	-	-	-	-	224,532.87
资产总计	78,494,401.13	16,567,980.72	7,940,195.25	7,281,531.62	8,220,820.25	22,964,885.93	141,469,814.90
以外币计价的负债							
应付证券清算款	-	332,028.26	-	-	-	-	332,028.26
其它应付款	-	20,156.46	-	-	-	206,689.27	226,845.73
负债合计	-	352,184.72	-	-	-	206,689.27	558,873.99
资产负债表外汇风险敞口净额	78,494,401.13	16,215,796.00	7,940,195.25	7,281,531.62	8,220,820.25	22,758,196.66	140,910,940.91

项目	上年度末 2010 年 12 月 31 日						
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	巴西雷亚尔 折合人民币	印尼盾 折合人民币	韩元 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产							
银行存款	14,384,976.40	-	26,013.75	-	-	1,375,716.74	15,786,706.89
交易性金融资产	92,971,427.37	29,361,394.11	17,272,898.96	16,352,731.34	9,502,771.48	30,450,286.37	195,911,509.63
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	501,219.00	-	501,219.00
应收利息	23.38	-	-	-	-	-	23.38
应收股利	17,160.28	-	24,559.57	15,133.6	-	-	56,853.45
资产总计	107,373,587.43	29,361,394.11	17,323,472.28	16,367,864.94	10,003,990.48	31,826,003.11	212,256,312.35
以外币计价的负债							

应付证券清算款	445,141.34	-	-	-	-	-	445,141.34
负债合计	445,141.34	-	-	-	-	-	445,141.34
资产负债表外汇 风险敞口净额	106,928,446.09	29,361,394.11	17,323,472.28	16,367,864.94	10,003,990.48	31,826,003.11	211,811,171.01

#### 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）
	美元相对人民币升值5%	3,924,720.06	5,346,422.30
	美元相对人民币贬值5%	-3,924,720.06	-5,346,422.30
	港币相对人民币升值5%	810,789.80	1,468,069.71
	港币相对人民币贬值5%	-810,789.80	-1,468,069.71
	巴西雷亚尔相对人民币升值5%	397,009.76	866,173.61
	巴西雷亚尔相对人民币贬值5%	-397,009.76	-866,173.61
	欧元相对人民币升值5%	364,076.58	-
	欧元相对人民币贬值5%	-364,076.58	-
	韩元相对人民币升值5%	411,041.01	500,199.52
	韩元相对人民币贬值5%	-411,041.01	-500,199.52
	印尼盾相对人民币升值5%	-	818,393.25
	印尼盾相对人民币贬值5%	-	-818,393.25

注：1、表中列示了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：国际资本市场股票、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	134,060,474.49	94.57	195,911,509.63	89.43
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	24,449.63	0.02	-	-
其他	-	-	-	-
合计	134,084,924.12	94.58	195,911,509.63	89.43

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%，投资于全球范围内具有竞争优势且成长性良好的上市公司。

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	1、假定本基金的业绩比较基准变化5%，其他变量不变；		
	2、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；		
	3、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%	6,088,612.45	3,450,209.80
业绩比较基准减少5%	-6,088,612.45	-3,450,209.80	

#### 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	134,060,474.49	93.16
	其中：普通股	122,625,233.65	85.21
	存托凭证	11,435,240.84	7.95
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	24,449.63	0.02
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	24,449.63	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	5,763,083.05	4.00
8	其他各项资产	4,053,160.65	2.82
9	合计	143,901,167.82	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	74,800,334.32	52.76
中国香港	16,523,374.63	11.66
巴西	7,919,959.27	5.59
韩国	7,268,711.64	5.13
日本	5,150,677.81	3.63
印度尼西亚	4,491,010.38	3.17
加拿大	3,363,799.05	2.37
德国	2,337,697.58	1.65

西班牙	2,184,048.18	1.54
澳大利亚	2,180,832.22	1.54
马来西亚	1,991,619.63	1.40
英国	1,259,478.43	0.89
新加坡	1,037,645.34	0.73
法国	970,756.44	0.68
比利时	963,314.29	0.68
荷兰	825,657.84	0.58
南非	791,557.44	0.56
合计	134,060,474.49	94.57

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	8,901,474.26	6.28
必需消费品 Consumer Staples	3,584,558.17	2.53
材料 Materials	20,161,456.77	14.22
电信服务 Telecommunication Services	2,163,612.08	1.53
非必需消费品 Consumer Discretionary	24,976,377.23	17.62
工业 Industrials	20,682,200.82	14.59
金融 financials	21,839,220.66	15.41
能源 Energy	19,724,951.16	13.91
信息技术 Information Technology	12,026,623.34	8.48
合计	134,060,474.49	94.57

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	CME Group Inc	芝加哥商业交易所控股公司	US12572Q1058	纳斯达克证券交易所	美国	2,300	4,340,223.84	3.06

2	Localiza Rent a Car SA	-	BRRENTAC NOR4	圣保罗 证券交 易所	巴西	36,478	4,201,452.82	2.96
3	Hyundai Mobis	现代精工	KR701233 0007	韩国证 券交易 所	韩国	1,605	3,891,354.96	2.74
4	Norfolk Southern Corp	诺福克南 方	US655844 1084	纽约证 券交易 所	美国	8,000	3,879,335.90	2.74
5	China Shineway Pharmace utical Group Ltd	中国神威 药业	KYG2110P 1000	香港证 券交易 所	中国香港	275,000	3,526,484.61	2.49
6	Kinross Gold Corp	-	CA496902 4047	多伦多 证券交 易所	加拿大	33,000	3,363,799.05	2.37
7	ICICI Bank Ltd	ICICI 银 行有限公 司	US45104G 1040	纽约证 券交易 所	美国	10,000	3,190,498.80	2.25
8	Home Inns & Hotels Manageme nt Inc	如家酒店 管理有限 公司	US43713W 1071	纳斯达 克证券 交易所	美国	12,500	3,077,245.80	2.17
9	Apache Corp	阿帕契	US037411 1054	纽约证 券交易 所	美国	3,600	2,874,710.61	2.03
10	HDFC Bank Ltd	HDFC 银行 有限公司	US40415F 1012	纽约证 券交易 所	美国	2,300	2,625,508.71	1.85
11	Celgene Corp	-	US151020 1049	纳斯达 克证券 交易所	美国	6,600	2,576,421.62	1.82
12	Weatherf ord Internat ional Ltd	-	CH003883 8394	纽约证 券交易 所	美国	20,000	2,426,850.00	1.71
13	Marvell Technolo gy Group Ltd	-	BMG5876H 1051	纳斯达 克证券 交易所	美国	25,052	2,393,798.12	1.69
14	Haier Electron ics Group	海尔电器	BMG42313 1256	香港证 券交易 所	中国香港	275,000	2,209,198.53	1.56

	Co Ltd							
15	Dollar Tree Inc	-	US256746 1080	纳斯达克 证券 交易所	美国	5,000	2,155,689.96	1.52
16	Expeditors International of Washington Inc	华盛顿康捷国际物流公司	US302130 1094	纳斯达克 证券 交易所	美国	6,000	1,987,687.22	1.40
17	Anadarko Petroleum Corp	阿纳达科石油	US032511 1070	纽约证 券交 易所	美国	3,500	1,738,660.06	1.23
18	Apple Inc	苹果电脑	US037833 1005	纳斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	800	1,737,857.58	1.23
19	China State Construction International Holdings Ltd	中国建筑国际	KYG21677 1363	香 港 证 券 交 易 所	中国香港	250,000	1,638,291.40	1.16
20	Alpha Natural Resources 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	5,500	1,617,382.27	1.14
21	National Oilwell Varco Inc	美国国民油井	US637071 1011	纽 约 证 券 交 易 所	美国	3,000	1,518,431.51	1.07
22	BM&FBovespa SA	-	BRBVMFAC NOR3	圣 保 罗 证 券 交 易 所	巴西	35,000	1,492,562.87	1.05
23	Dongfeng Motor Group Co Ltd	东风汽车	CNE10000 0312	香 港 证 券 交 易 所	中国香港	122,000	1,491,427.31	1.05
24	LG Chem Ltd	LG 化学有限公司	KR705191 0008	韩 国 证 券 交 易 所	韩国	500	1,478,957.34	1.04
25	Transocean Ltd/Switzerland	-	CH004826 5513	纽 约 证 券 交 易 所	美国	3,537	1,477,781.58	1.04

26	Chevron Corp	雪佛龙德士古	US1667641005	纽约证券交易所	美国	2,200	1,464,186.56	1.03
27	ConocoPhillips	康菲石油	US20825C1045	纽约证券交易所	美国	3,000	1,459,798.81	1.03
28	Intercontinental Exchange Inc	洲际交易所公司 (ICE)	US45865V1008	纽约证券交易所	美国	1,800	1,452,731.82	1.02
29	Yum! Brands Inc	百胜全球餐饮	US9884981013	纽约证券交易所	美国	4,000	1,429,964.74	1.01
30	Daelim Industrial Co Ltd	大林工程有限公司	KR7000210005	韩国证券交易所	韩国	1,800	1,401,978.82	0.99
31	Union Pacific Corp	联合太平洋	US9078181081	纽约证券交易所	美国	2,000	1,351,270.08	0.95
32	Asahi Kasei Corp	旭化成	JP3111200006	东京证券交易所	日本	30,000	1,299,936.60	0.92
33	Weichai Power Co Ltd	潍柴动力	CNE1000004L9	香港证券交易所	中国香港	34,000	1,283,688.63	0.91
34	Southern Copper Corp	南方铜业公司	US84265V1052	纽约证券交易所	美国	6,000	1,276,328.95	0.90
35	Petrofac Ltd	-	GB00B0H2K534	伦敦证券交易所	英国	8,000	1,259,478.43	0.89
36	Stryker Corp	史赛克	US8636671013	纽约证券交易所	美国	3,300	1,253,400.07	0.88
37	Occidental Petroleum Corp	西方石油	US6745991058	纽约证券交易所	美国	1,800	1,211,949.48	0.85
38	QSR Brands Bhd	-	MYL941500000	吉隆坡证券交易所	马来西亚	96,000	1,202,668.03	0.85
39	DST Systems Inc	-	US2333261079	纽约证券交易所	美国	3,500	1,195,951.68	0.84

40	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	西班牙对外银行	ES0113211835	西班牙证券交易所	西班牙	15,304	1,159,004.18	0.82
41	Banco do Brasil SA	巴西银行股份有限公司	BRBBASACNOR3	圣保罗证券交易所	巴西	10,000	1,155,905.42	0.82
42	Nippon Electric Glass Co Ltd	-	JP3733400000	东京证券交易所	日本	14,000	1,152,610.45	0.81
43	China Communications Services Corp Ltd	中国通信服务股份	CNE1000002G3	香港证券交易所	中国香港	300,000	1,147,635.60	0.81
44	MGM Resorts International	美高梅国际酒店集团	US5529531015	纽约证券交易所	美国	13,000	1,111,367.87	0.78
45	Indofood Sukses Makmur Tbk PT	-	ID1000057003	印尼证券交易所	印度尼西亚	250,000	1,083,874.49	0.76
46	Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	-	ID1000118201	印尼证券交易所	印度尼西亚	220,000	1,078,219.49	0.76
47	MRV Engenharia Participacoes SA	-	BRMRVEACNOR2	圣保罗证券交易所	巴西	20,000	1,070,038.16	0.75
48	eBay Inc	电子湾	US2786421030	纳斯达克证券交易所	美国	5,000	1,044,192.66	0.74
49	Noble Group Ltd	来宝集团	BMG6542T1190	新加坡证券交易所	新加坡	100,000	1,037,645.34	0.73
50	Banco Santander SA	桑坦德	ES0113900J37	西班牙证券交易所	西班牙	13,751	1,025,044.00	0.72
51	Harris	哈里斯公	US413875	纽约证	美国	3,500	1,020,636.04	0.72

	Corp	司	1056	券交易 所				
52	American Tower Corp	美国发射 塔公司	US029912 2012	纽约证 券交易 所	美国	3,000	1,015,976.48	0.72
53	Microsof t Corp	微软	US594918 1045	纳斯达 克证券 交易所	美国	6,000	1,009,569.60	0.71
54	Sega Sammy Holdings Inc	-	JP341905 0004	东京证 券交易 所	日本	8,000	994,371.26	0.70
55	Family Dollar Stores Inc	家庭美元 商店	US307000 1090	纽约证 券交易 所	美国	2,878	978,943.92	0.69
56	General Electric Co	通用电气	US369604 1033	纽约证 券交易 所	美国	8,000	976,435.01	0.69
57	Credit Agricole SA	法国农业 信贷银行	FR000004 5072	巴黎证 券交易 所	法国	10,000	970,756.44	0.68
58	Ageas	-	BE000380 1181	布鲁塞 尔证券 交易所	比利时	55,000	963,314.29	0.68
59	Astra Internat ional Tbk PT	-	ID100005 7607	印尼证 券交易 所	印度尼西 亚	20,000	958,333.55	0.68
60	Exxon Mobil Corp	艾克森美 孚石油	US30231G 1022	纽约证 券交易 所	美国	1,800	947,985.85	0.67
61	Ross Stores Inc	-	US778296 1038	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,800	933,308.27	0.66
62	Mechel	-	US583840 1033	纽约证 券交易 所	美国	6,000	927,639.14	0.65
63	Southwes tern Energy Co	西南能源 公司	US845467 1095	纽约证 券交易 所	美国	3,300	915,757.29	0.65
64	Newmont Mining Corp	纽蒙特矿 业	US651639 1066	纽约证 券交易 所	美国	2,567	896,581.87	0.63



65	Itau Unibanco Holding SA	-	US4655621062	纽约证券交易所	美国	5,844	890,661.72	0.63
66	NGK Spark Plug Co Ltd	-	JP3738600000	东京证券交易所	日本	10,000	888,290.01	0.63
67	CSX Corp	-	US1264081035	纽约证券交易所	美国	5,100	865,395.30	0.61
68	Freeport-McMoRan Copper & Gold Inc	自由港迈克墨伦	US35671D8570	纽约证券交易所	美国	2,500	855,869.10	0.60
69	Wacker Chemie AG	瓦克化学股份公司	DE000WCH8881	德国证券交易所	德国	600	837,452.95	0.59
70	International Business Machines Corp	国际商业机器	US4592001014	纽约证券交易所	美国	750	832,652.24	0.59
71	Heineken Holding NV	荷兰喜力控股公司	NL0000008977	阿姆斯特丹证券交易所	荷兰	2,500	825,657.84	0.58
72	Nitto Denko Corp	-	JP3684000007	东京证券交易所	日本	2,500	815,469.49	0.58
73	Gilead Sciences Inc	-	US3755581036	纳斯达克证券交易所	美国	3,000	803,966.87	0.57
74	Bidvest Group Ltd	-	ZAE000117321	约翰内斯堡证券交易所	南非	5,500	791,557.44	0.56
75	Tencent Holdings Ltd	腾讯	KYG875721485	香港证券交易所	中国香港	4,500	790,371.65	0.56
76	Hong Leong Financial Group Bhd	-	MYL108200006	吉隆坡证券交易所	马来西亚	28,000	788,951.60	0.56

77	Sands China Ltd	金沙中国	KYG7800X 1079	香港证 券交易 所	中国香港	45,000	785,880.90	0.55
78	Le Saunda Holdings Ltd	利信达集 团	BMG5456B 1063	香港证 券交易 所	中国香港	200,000	770,080.12	0.54
79	BHP Billiton Ltd	必和必拓 有限公司	AU000000 BHP4	澳大利 亚证券 交易所	澳大利亚	2,500	760,300.07	0.54
80	BASF SE	巴斯夫欧 洲公司	DE000BAS F111	德国证 券交易 所	德国	1,200	759,043.54	0.54
81	China Agri-Ind ustries Holdings Ltd	中国粮油 控股	HK060603 7437	香港证 券交易 所	中国香港	110,000	753,780.37	0.53
82	Freseni us SE & Co KGaA	费森尤斯 集团	DE000578 5604	德国证 券交易 所	德国	1,100	741,201.09	0.52
83	Potash Corp of Saskatch ewan Inc	萨斯喀彻 温省钾肥 股份有限 公司	CA73755L 1076	纽约证 券交易 所	美国	2,000	737,632.97	0.52
84	Zijin Mining Group Co Ltd	紫金矿业	CNE10000 0502	香港证 券交易 所	中国香港	226,500	734,611.53	0.52
85	Harbin Electric Inc	哈尔滨泰 富电器	US41145W 1099	纳斯达 克证券 交易所	美国	7,500	733,879.44	0.52
86	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	2,800	733,137.57	0.52
87	Vale SA	淡水河谷 公司	US91912E 1055	纽约证 券交易 所	美国	3,500	723,686.67	0.51
88	Mayora Indah Tbk PT	-	ID100006 0007	印尼证 券交易 所	印度尼西 亚	73,000	715,545.66	0.50
89	China Citic Bank Corp Ltd	中信银行	CNE10000 01Q4	香港证 券交易 所	中国香港	175,000	705,837.48	0.50

90	Monsanto Co	孟山都	US61166W 1018	纽约证 券交易 所	美国	1,500	704,174.80	0.50
91	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	750	687,623.68	0.49
92	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	7,500	687,394.58	0.48
93	Embry Holdings Ltd	安莉芳	KYG3066H 1002	香港证 券交易 所	中国香港	150,000	686,086.50	0.48
94	Cliffs Natural Resource s Inc	克里夫斯 自然资源 股份有限 公司	US18683K 1016	纽约证 券交易 所	美国	1,000	598,299.42	0.42
95	Deere & Co	迪尔	US244199 1054	纽约证 券交易 所	美国	1,000	533,583.42	0.38
96	Cisco Systems Inc	思科	US17275R 1023	纳斯达 克证券 交易所	美国	5,000	505,108.38	0.36
97	Korea Zinc Co Ltd	高丽亚铅 公司	KR701013 0003	韩国证 券交易 所	韩国	200	496,420.52	0.35
98	Molycorp Inc	-	US608753 1090	纽约证 券交易 所	美国	1,200	474,187.08	0.33
99	Murphy Oil Corp	墨菲石油 公司	US626717 1022	纽约证 券交易 所	美国	1,000	424,925.26	0.30
100	Hess Corp	阿美拉达 赫斯	US42809H 1077	纽约证 券交易 所	美国	800	387,053.45	0.27
101	Lam Research Corp	-	US512807 1082	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,200	343,874.94	0.24
102	Ace Hardware Indonesi a Tbk PT	-	ID100010 8004	印尼证 券交易 所	印度尼西 亚	150,000	342,127.34	0.24
103	Aneka	-	ID100010	印尼证	印度尼西	200,000	312,909.85	0.22

	Tambang Tbk PT		6602	券交易所	亚			
104	Procter & Gamble Co/The	宝洁	US7427181091	纽约证 券交易 所	美国	500	205,699.81	0.15

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	CHINA SHINEWAY PHARMACEUTICA	KYG2110P1000	4,854,464.00	2.22
2	HOME INNS & HOTELS MANAG	US43713W1071	4,404,392.35	2.01
3	ICICI BANK LTD	US45104G1040	3,869,094.26	1.77
4	NORFOLK SOUTHERN CORP	US6558441084	3,705,846.68	1.69
5	HYUNDAI MOBIS	KR7012330007	3,620,336.64	1.65
6	TENCENT HOLDINGS LTD	KYG875721485	3,614,821.35	1.65
7	HDFC BANK LTD	US40415F1012	3,301,361.33	1.51
8	CELGENE CORP	US1510201049	3,203,708.58	1.46
9	SANDS CHINA LTD	KYG7800X1079	3,125,677.51	1.43
10	AGEAS	BE0003801181	3,045,879.81	1.39
11	INTESA SANPAOLO	IT0000072618	3,019,684.74	1.38
12	CREDIT AGRICOLE SA	FR0000045072	2,868,765.17	1.31
13	DAELIM INDUSTRIAL CO LTD	KR7000210005	2,787,583.45	1.27
14	WEATHERFORD INTL LTD	CH0038838394	2,739,117.35	1.25
15	NESTLE SA-REG	CH0038863350	2,726,795.74	1.24
16	YAHOO! INC	US9843321061	2,544,309.15	1.16
17	CHINA SHENHUA ENERGY CO	CNE1000002R0	2,454,682.22	1.12
18	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	ES0113211835	2,450,671.68	1.12
19	CHINA YURUN FOOD GROUP LTD	BMG211591018	2,442,587.38	1.11
20	MECHEL	US5838401033	2,336,457.59	1.07

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	HYUNDAI MOBIS	KR7012330007	7,911,528.78	3.61
2	HDFC BANK LTD	US40415F1012	5,019,955.67	2.29
3	SANDS CHINA LTD	KYG7800X1079	4,566,511.92	2.08
4	ICICI BANK LTD	US45104G1040	4,303,611.75	1.96
5	CHINA STATE CONSTRUCTION INT	KYG216771363	4,223,156.77	1.93
6	MECHEL	US5838401033	4,184,883.16	1.91
7	CSX CORP	US1264081035	4,060,591.34	1.85
8	NEWCREST MINING LTD	AU000000NCM7	3,672,288.21	1.68
9	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	ID1000057607	3,669,142.64	1.67
10	CELGENE CORP	US1510201049	3,604,495.49	1.65
11	GILEAD SCIENCES INC	US3755581036	3,514,575.59	1.60
12	HAIER ELECTRONICS GROUP CO	BMG423131256	3,386,926.38	1.55
13	CIA SIDERURGICA NACL	US20440W1053	3,206,090.13	1.46
14	INTESA SANPAOLO	IT0000072618	3,118,338.86	1.42
15	HANKOOK TIRE CO LTD	KR7000240002	3,089,056.49	1.41
16	NESTLE SA-REG	CH0038863350	2,964,568.60	1.35
17	CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	HK0688002218	2,923,062.26	1.33
18	ITAU UNIBANCO HLDNG	US4655621062	2,890,136.80	1.32
19	NEWMONT MINING CORP	US6516391066	2,866,552.06	1.31
20	MONSANTO CO	US61166W1018	2,828,040.56	1.29

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	171,736,030.01
卖出收入（成交）总额	232,155,160.02

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	24,449.63	0.02

**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。

7.11.2 本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	3,608,764.42
3	应收股利	206,329.74
4	应收利息	544.18
5	应收申购款	12,989.44
6	其他应收款	224,532.87
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,053,160.65

**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
9,645	13,907.62	1,083,743.83	0.81%	133,055,235.18	99.19%

**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	112,998.97	0.08%

**§ 9 开放式基金份额变动**

单位：份

基金合同生效日（2010年5月25日）基金份额总额	585,845,814.67
本报告期期初基金份额总额	204,745,354.26
本报告期基金总申购份额	5,055,412.50
减：本报告期基金总赎回份额	75,661,787.75
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	134,138,979.01

**§ 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	-	332,210,622.39	82.26%	144,654.23	83.18%	-
Goldman Sachs	-	59,964,728.18	14.85%	17,989.37	10.34%	-
UBS	-	8,027,184.82	1.99%	8,027.18	4.62%	新增
Morgan Stanley	-	3,659,482.55	0.91%	3,239.78	1.86%	-
BNP Paribas	-	-	-	-	-	-
CLSA Ltd.	-	-	-	-	-	-

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	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
CREDIT SUISSE Securities	-	-	-	-	30,409.36	100.00%	-	-
Goldman Sachs	-	-	-	-	-	-	-	-
UBS	-	-	-	-	-	-	-	-
Morgan Stanley	-	-	-	-	-	-	-	-
BNP Paribas	-	-	-	-	-	-	-	-
CLSA Ltd.	-	-	-	-	-	-	-	-

### 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	工银瑞信全球精选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	工银瑞信全球精选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	工银瑞信全球精选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、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

- 1、中国证监会批准工银瑞信全球精选股票型证券投资基金募集的文件
- 2、《工银瑞信全球精选股票型证券投资基金基金合同》
- 3、《工银瑞信全球精选股票型证券投资基金托管协议》
- 4、《工银瑞信全球精选股票型证券投资基金招募说明书》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照
- 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](http://www.icbccs.com.cn)