

# 工银瑞信精选平衡混合型证券投资基金 2011 年年度报告

2011 年 12 月 31 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：二〇一二年三月二十九日

## § 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 2012 年 3 月 27 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。

本报告期自 2011 年 01 月 01 日起至 12 月 31 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 信息披露方式 .....	6
2.5 其他相关资料 .....	6
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</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 过去三年基金的利润分配情况 .....	8
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 .....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 .....	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	13
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	14
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 .....	14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 .....	14
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>14</b>
6.1 审计报告基本信息 .....	14
6.2 审计报告的基本内容 .....	14
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>15</b>
7.1 资产负债表 .....	15
7.2 利润表 .....	16
7.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....	17
7.4 报表附注 .....	19
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>42</b>
8.1 期末基金资产组合情况 .....	42
8.2 期末按行业分类的股票投资组合 .....	42
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	43
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	45
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	47
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细 .....	47
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	48
8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细 .....	48

8.9 投资组合报告附注 .....	48
<b>§9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>49</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	49
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况 .....	49
<b>§10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>49</b>
<b>§11 重大事件揭示 .....</b>	<b>49</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	49
11.2 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 .....	49
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	50
11.4 基金投资策略的改变 .....	50
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	50
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	50
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	50
11.8 其他重大事件 .....	53
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>54</b>
<b>§13 备查文件目录 .....</b>	<b>54</b>
13.1 备查文件目录 .....	54
13.2 存放地点 .....	54
13.3 查阅方式 .....	54

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	工银瑞信精选平衡混合型证券投资基金
基金简称	工银精选平衡混合
基金主代码	483003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006 年 7 月 13 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	10,510,212,623.72 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	有效控制投资组合风险，追求稳定收益与长期资本增值。
投资策略	本基金专注基本面研究，遵循系统化、程序化的投资流程以保证投资决策的科学性与一致性。
业绩比较基准	60%×沪深 300 指数收益率+40%×新华巴克莱资本中国综合债券指数收益率。
风险收益特征	本基金是混合型基金，其预期收益及风险水平介于股票型基金与债券型基金之间，属于中等风险水平基金。

### 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	王洪章

## 2.4 信息披露方式

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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼16层
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、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2011 年	2010 年	2009 年
本期已实现收益	-482,404,799.95	621,025,004.05	938,364,372.21
本期利润	-1,182,537,222.42	-193,028,284.74	3,281,071,606.69
加权平均基金份额本期利润	-0.1117	-0.0185	0.2889
本期加权平均净值利润率	-18.30%	-2.60%	39.79%
本期基金份额净值增长率	-17.29%	-2.41%	50.53%
3.1.2 期末数据和指标	2011 年末	2010 年末	2009 年末
期末可供分配利润	-225,249,003.95	858,501,057.89	1,264,471,593.49
期末可供分配基金份额利润	-0.0214	0.0781	0.1157
期末基金资产净值	5,654,062,293.37	7,149,946,689.13	8,360,615,554.84
期末基金份额净值	0.5380	0.6505	0.7653
3.1.3 累计期末指标	2011 年末	2010 年末	2009 年末
基金份额累计净值增长率	64.27%	98.62%	103.53%

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 2006 年 7 月 13 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

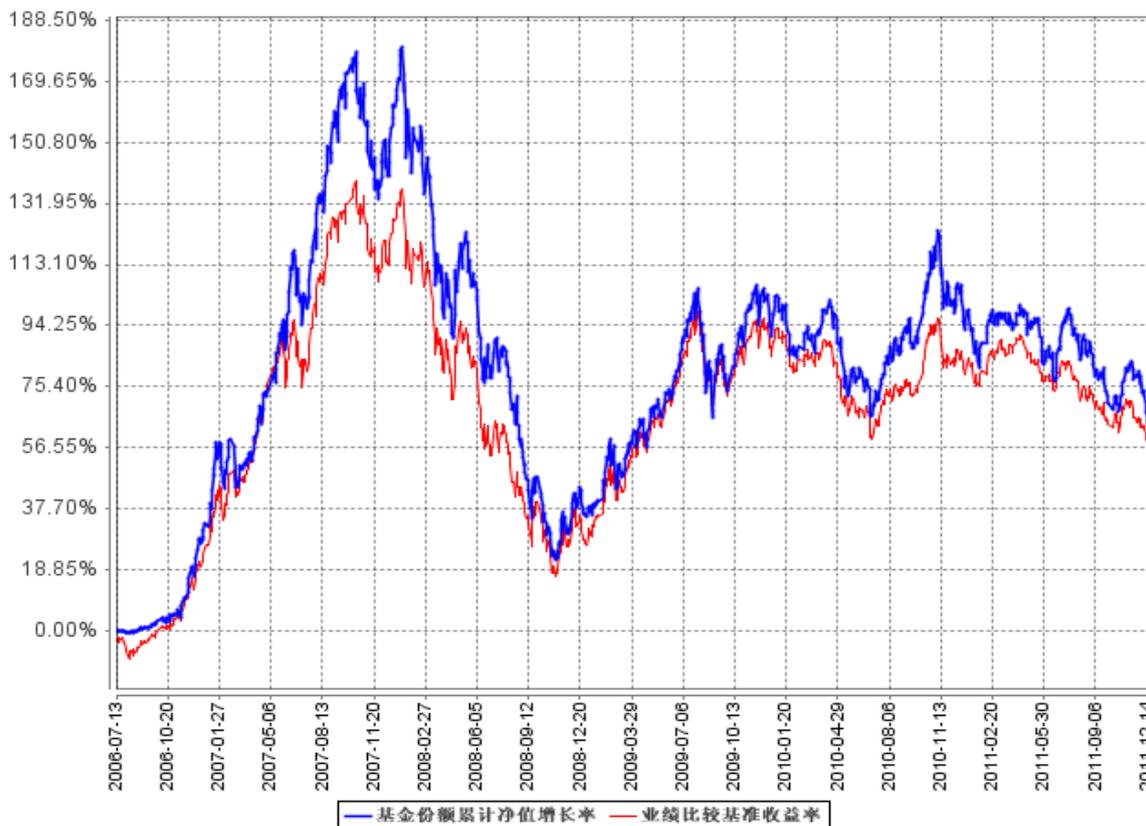
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-3.58%	0.99%	-4.38%	0.84%	0.80%	0.15%
过去六个月	-13.16%	0.96%	-13.14%	0.82%	-0.02%	0.14%
过去一年	-17.29%	0.98%	-14.01%	0.78%	-3.28%	0.20%
过去三年	21.50%	1.24%	23.75%	1.01%	-2.25%	0.23%
过去五年	23.39%	1.50%	24.65%	1.30%	-1.26%	0.20%
自基金合同生效起至今	64.27%	1.45%	56.54%	1.27%	7.73%	0.18%

注：1、本基金业绩比较基准为 60%×沪深 300 指数收益率+40%×新华巴克莱资本中国综合债券指数收益率，每日进行再平衡过程；

2、本基金基金合同生效日为 2006 年 7 月 13 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



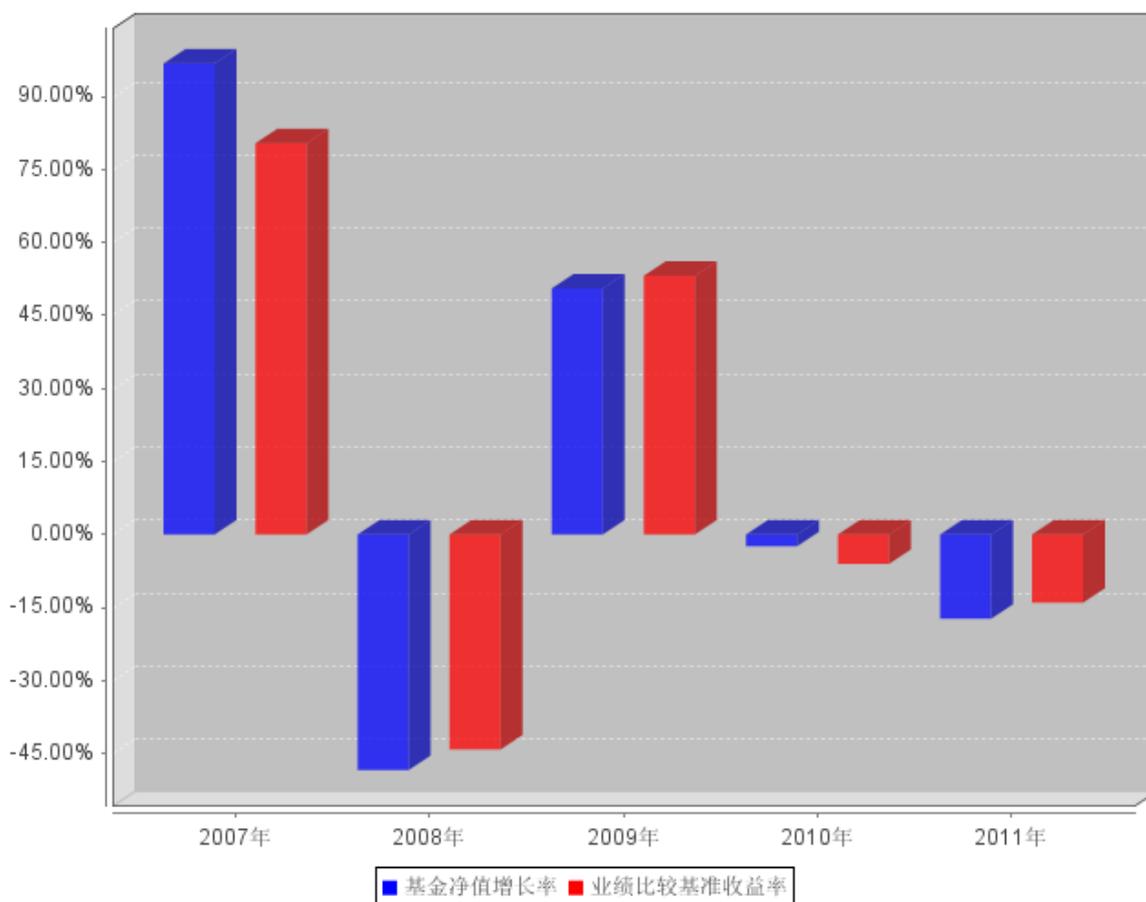
注：1、本基金基金合同生效日为 2006 年 7 月 13 日，按基金合同规定，本基金自基金合同生效起六个

月内为建仓期，截至报告期末本基金的各项投资比例符合基金合同第十二条（三）投资范围、（七）投资组合限制与禁止行为中规定的各项比例。

2、本基金股票资产占基金资产净值的比例为 40%-80%，债券及其它短期金融工具占基金资产净值的比例为 20%-60%，本基金持有的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百分之五，持有的可转换债券不超过基金资产净值的 20%，持有的权证总市值不超过基金资产净值的 3%。

### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：1、本基金基金合同生效日为 2006 年 7 月 13 日；

2、合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2011	-	-	-	-	
2010	1.000	466,489,456.95	549,168,551.28	1,015,658,008.23	
2009	1.000	451,506,984.54	605,552,893.03	1,057,059,877.57	

合计	2.000	917,996,441.49	1,154,721,444.31	2,072,717,885.80	
----	-------	----------------	------------------	------------------	--

## § 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、全国社保基金境内投资管理人资格。

截至 2011 年 12 月 31 日，公司旗下管理 21 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及工银瑞信深证红利 ETF 联接基金、工银瑞信四季收益债券型证券投资基金、工银瑞信消费服务行业股票型证券投资基金、工银瑞信添颐债券型证券投资基金、工银瑞信主题策略股票型证券投资基金、工银瑞信保本混合型证券投资基金，证券投资基金管理规模达 690 亿元人民币。

#### 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		
曲丽	本基金的基金经理	2007 年 11 月 12 日	-	10	曾任中信建投证券有限公司资深分析师；2007 年加入工银瑞信基金管理有限公司；2007 年 1 月至 2009 年 11 月，

					担任高级研究员；2009年11月18日至今任职于权益投资部，2007年11月12日至今担任工银精选平衡基金基金经理。
陈守红	曾任本基金的基金经理、工银瑞信大盘蓝筹基金的基金经理	2010年1月25日	2011年4月13日	14	曾任巨田基金管理有限公司投资副总监、巨田基础行业基金基金经理；2007年加入工银瑞信，2008年8月4日至2011年4月13日担任工银大盘蓝筹基金基金经理，2010年1月25日至2011年4月13日担任工银精选平衡基金基金经理。

注：1、任职日期说明：曲丽的任职日期为公司执委会决议日期；

2、离任日期说明：陈守红的离任日期为公司执委会决议日期；

3、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；

4、本基金无基金经理助理。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金持有人利益的行为。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

为了公平对待各类投资人，保护各类投资人利益，避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为，公司根据《证券投资基金法》、《基金管理公司特定客户资产管理业务试点办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规和公司内部规章，拟定了《公平交易管理办法》、《异常交易管理办法》，对公司管理的各类资产的公平对待做了明确具体的规定，并规定对买卖股票、债券时候的价格和市场价格差距较大，可能存在操纵股价、利益输送等违法违规情况进行监控。本报告期，按照时间优先、价格优先的原则，本公司对满足限价条件且对同一证券有相同交易需求的基金等投资组合，均采用了系统中的公平交易模块进行操作，实现了公平交易；未出现清算不到位的情况，且本基金及本基金与本基金管理人管理的其他投资组合之间未发生法律法规禁止的反向交易及交叉交易。

### 4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

无，因报告期内本公司旗下没有与本基金投资风格相似的投资组合。

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金报告期内无异常交易行为。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾 2011 年，重仓股的表现多数做到了相对收益，例如白酒和医疗服务类型的股票。表现较差的主要集中在机械板块。年初重仓的中集、柳工出现了较深度的跌幅。对于 2011 年跌幅较深的地产、保险、银行我们参与的较少。在 2010 年底对 2011 年流动性收紧的判断下，坚持自下而上的选择，深入挖掘个股。因此在跟踪密切，研究深入的个股上参与程度比较高。坚持长期投资，分享企业成长带来的资本利得收益。对市场偏于谨慎的看法使我们 2011 年全年保持了中性偏低的仓位。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2011 年，本基金份额净值增长率为 -17.29%，比较基准收益率为 -14.01%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

无论 2012 年的经济状况如何，市场风格的转换，还是流动性继续收紧，我们都坚持认为现在的资本市场是越来越适合坚持价值的、长期的投资理念了。选股的超额收益将日益明显，基金经理的专业投资优势会更加突出。“稳中求进”也适合于 2012 年的投资理念，在保持投资成果下追求进一步的发展。从宏观上看，流动性收紧的任务还任重而道远，房地产政策也不会轻易回到过去简单的拿地卖房子模式上来。房地产行业的创新、融资的创新、经营模式的创新都将进入 2012 年的视野。中国经济结构转型将向深层次发展，一些传统产业的产能过剩将面临市场化与行政手段并存的淘汰过程。转型期对经济的影响会被资本市场放大而表现在股市的大幅波动性上。今年资本市场的融资仍然成为对股市最重要的影响因素之一。不确定性因素看起来不比 2011 年少，今年下半年确定性将好于上半年。我们对于 2012 年的看法是上半年仍坚持自下而上的选股策略，偏重于食品饮料、医疗服务、品牌服装、环保等类型的股票。下半年在国际、国内经济增长确定性增加下加强自上而下的行业配置。

## 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

4.6.1 加强合规风险的事前控制，认真履行依法监督检查职责，促进基金运作的合法合规性和风险管理水平的提高

1、严格事前的监督审查和控制机制，保障业务开展的合法合规性。对基金募集和持续营销、基金等各受托资产的投资管理、基金信息披露等方面都进行了事先的合法合规性审核工作，并利用系统对相关投资组合的合规风险实现事前控制。

2、进行重点业务的事中、事后监控，主要是利用系统和人工方式，对投资交易活动和重大投诉和处理情况进行合法合规性监控，对其中的合规风险进行提示和督促改进。

3、利用系统对本基金及本基金与基金管理人管理的其他基金等投资组合之间的公平交易情况进行检查。

4、定期对基金各项业务开展情况、内部规章制度执行情况、合规控制和风险控制情况进行系统全面的检查和评价，并及时督促业务部门改进存在的问题。

5、全面梳理各项业务的合规风险，对其中的合规风险进行识别、评估，并对现有的控制手段提出改进性建议。

4.6.2 根据新出台的法律法规和行业的新要求，督促公司及时制定、更新规章制度和业务流程

4.6.3 加强法律法规的教育和培训，促进公司合规文化的建设

1、有计划、有针对性地进行法律、合规培训，对新入职的员工开展合规培训，定期组织针对全体

员工的年度合规培训，并在日常工作中不定期的针对投资管理人员及其他相关业务人员组织多种形式的合规培训。

- 2、每当新法规出台时，及时向公司员工发送并对有关新法规的主要条款进行解释或培训。
- 3、年底，组织员工签署合规声明，明确对员工的合规要求，促进员工合规意识的提升。

4.6.4 依照法律法规和公司章程向董事会报告工作，保障董事会对公司和基金合规运作和风险控制情况的知情权和监督权

#### 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

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

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

4.7.1.2 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，符合相关法规及基金合同的规定。

## § 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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明(2012)审字第 60802052_A04 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	工银瑞信精选平衡混合型证券投资基金全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的工银瑞信精选平衡混合型证券投资基金财务报表，包括 2011 年 12 月 31 日的资产负债表和 2011 年度的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是基金管理人工银瑞信基金管理有限公司的责任。这种责任包括：(1)按照企业会计准则的规定编制财务报表，并使其实现公允反映；(2)设计、实施和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。

注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价基金管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
审计意见段	我们认为，上述财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了工银瑞信精选平衡混合型证券投资基金 2011 年 12 月 31 日的财务状况以及 2011 年度的经营成果和净值变动情况。
注册会计师的姓名	李慧民 王珊珊
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 16 层
审计报告日期	2012 年 3 月 28 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：工银瑞信精选平衡混合型证券投资基金

报告截止日：2011 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2011 年 12 月 31 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	538,341,242.76	446,508,021.17
结算备付金		57,213,504.31	16,310,044.50
存出保证金		5,023,581.67	5,210,184.31
交易性金融资产	7.4.7.2	5,103,324,751.65	6,765,874,226.75
其中：股票投资		4,001,563,049.35	5,150,470,106.61
基金投资		-	-
债券投资		1,101,761,702.30	1,615,404,120.14
资产支持证券投资		-	-

衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	150,000,000.00	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	10,951,680.15	18,166,165.33
应收股利		-	-
应收申购款		52,860.80	1,106,495.16
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		5,864,907,621.34	7,253,175,137.22
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2011年12月31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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		194,854,234.32	71,503,718.40
应付赎回款		814,045.06	2,246,231.58
应付管理人报酬		7,427,046.25	9,051,441.14
应付托管费		1,237,841.04	1,508,573.51
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	3,466,416.13	16,501,455.36
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	3,045,745.17	2,417,028.10
负债合计		210,845,327.97	103,228,448.09
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	7.4.7.9	5,879,311,297.32	6,148,966,254.20
未分配利润	7.4.7.10	-225,249,003.95	1,000,980,434.93
所有者权益合计		5,654,062,293.37	7,149,946,689.13
负债和所有者权益总计		5,864,907,621.34	7,253,175,137.22

注：报告截止日 2011 年 12 月 31 日，基金份额净值为人民币 0.5380 元，基金份额总额为 10,510,212,623.72 份。

## 7.2 利润表

会计主体：工银瑞信精选平衡混合型证券投资基金

本报告期：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2011年1月1日至 2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至 2010年12月31日
<b>一、收入</b>		-1,031,565,770.77	10,991,244.72
1. 利息收入		56,603,919.79	58,089,341.72
其中：存款利息收入	7.4.7.11	4,930,781.38	4,260,619.96
债券利息收入		46,984,782.36	51,005,833.35
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		4,688,356.05	2,822,888.41
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-388,260,006.64	766,427,641.41
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-369,929,970.69	686,382,216.07
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-51,077,313.07	47,261,476.26
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	32,747,277.12	32,783,949.08
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-700,132,422.47	-814,053,288.79
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	222,738.55	527,550.38
<b>减：二、费用</b>		150,971,451.65	204,019,529.46
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	97,023,339.14	111,196,426.41
2. 托管费	7.4.10.2.2	16,170,556.58	18,532,737.74
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	35,724,838.18	72,020,488.86
5. 利息支出		1,566,255.11	1,766,798.62
其中：卖出回购金融资产支出		1,566,255.11	1,766,798.62
6. 其他费用	7.4.7.19	486,462.64	503,077.83
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-1,182,537,222.42	-193,028,284.74
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-1,182,537,222.42	-193,028,284.74

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：工银瑞信精选平衡混合型证券投资基金

本报告期：2011年1月1日至2011年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31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）	6,148,966,254.20	1,000,980,434.93	7,149,946,689.13
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-1,182,537,222.42	-1,182,537,222.42
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）	-269,654,956.88	-43,692,216.46	-313,347,173.34
其中：1. 基金申购款	297,833,296.10	25,837,082.92	323,670,379.02
2. 基金赎回款	-567,488,252.98	-69,529,299.38	-637,017,552.36
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）	5,879,311,297.32	-225,249,003.95	5,654,062,293.37
	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日		
项目	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）	6,111,450,516.53	2,249,165,038.31	8,360,615,554.84
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-193,028,284.74	-193,028,284.74
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）	37,515,737.67	-39,498,310.41	-1,982,572.74
其中：1. 基金申购款	1,162,607,920.47	308,635,918.32	1,471,243,838.79
2. 基金赎回款	-1,125,092,182.80	-348,134,228.73	-1,473,226,411.53
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）	-	-1,015,658,008.23	-1,015,658,008.23
五、期末所有者权益（基金净值）	6,148,966,254.20	1,000,980,434.93	7,149,946,689.13

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

郭特华

夏洪彬

朱辉毅

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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

工银瑞信精选平衡混合型证券投资基金（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[2006]104 号文《关于同意工银瑞信精选平衡混合型证券投资基金募集的批复》的核准，由基金管理人工银瑞信基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于 2006 年 7 月 13 日正式生效，首次设立募集规模为 8,369,914,482.23 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为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。

本基金的投资范围限于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券、中央银行票据、回购，以及法律法规规定或经中国证监会批准基金投资的其他金融工具。本基金投资组合资产配置范围为：股票资产占基金资产净值的比例为 40%-80%，债券及其它短期金融工具占基金资产净值的比例为 20%-60%。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×60%+新华巴克莱资本中国综合债券指数收益率×40%。

### 7.4.2 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（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了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 2 号《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。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

### 7.4.3 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 12 月 31 日的财务状

况以及 2011 年度的经营成果和净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则及应用指南、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

###### (1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金目前持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资、债券投资和衍生工具（主要系权证投资）；

###### (2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

##### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认

为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

金融资产转移，是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方（转入方）；本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债；

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

#### (1) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

#### (2) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

#### (3) 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

#### (4) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值

的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

#### (5) 回购协议

本基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指在公平交易中熟悉情况的交易双方自愿进行资产交换或者债务清偿的金额。本基金的公允价值的计量分为三个层次，第一层次是本基金在计量日能获得相同资产或负债在活跃市场上报价的，以该报价为依据确定公允价值；第二层次是本基金在计量日能获得类似资产或负债在活跃市场上的报价，或相同或类似资产或负债在非活跃市场上的报价的，以该报价为依据做必要调整确定公允价值；第三层次是本基金无法获得相同或类似资产可比市场交易价格的，以其他反映市场参与者对资产或负债定价时所使用的参数为依据确定公允价值。本基金主要金融工具的估值方法如下：

#### 1) 股票投资

##### (1) 上市流通的股票的估值

上市流通的股票按估值日该股票在证券交易所的收盘价估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

##### (2) 未上市的股票的估值

A. 送股、转增股、增发新股或配股的股票，以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值；

B. 首次公开发行的股票，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按其成本价计算；

首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值；

##### C. 非公开发行有明确锁定期的股票的估值

本基金投资的非公开发行的股票按以下方法估值：

a. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价低于非公开发行股票的首次取得成本时，采用在证券交易所的同一股票的市价作为估值日该非公开发行股票的价值；

b. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价高于非公开发行股票的首次取得成本时，按中国证监会相关规定处理；

## 2) 债券投资

(1) 证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘价估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2) 证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日债券收盘净价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(3) 未上市债券、交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量；

(4) 在全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值；

## 3) 权证投资

(1) 上市流通的权证按估值日该权证在证券交易所的收盘价估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2) 未上市流通的权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本计量；

(3) 因持有股票而享有的配股权证，采用估值技术确定公允价值进行估值；

#### 4) 分离交易可转债

分离交易可转债，上市日前，采用估值技术分别对债券和权证进行估值；自上市日起，上市流通的债券和权证分别按上述 2)、3) 中的相关原则进行估值；

#### 5) 其他

(1) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映金融资产公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(2) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议

规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 衍生工具收益/（损失）于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(8) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(9) 公允价值变动收益/（损失）系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(10) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 1.50% 的年费率逐日计提；

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率逐日计提；

(3) 卖出回购证券支出，按卖出回购金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；

(4) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 本基金的每份基金份额享有同等分配权；

- (2) 基金收益分配后每一基金份额净值不能低于面值；
- (3) 收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担。当投资人的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金注册登记机构可将投资人的现金红利按红利发放日的基金份额净值自动转为基金份额；
- (4) 本基金收益每年最多分配四次，每次基金收益分配比例不低于可分配收益的 50%；
- (5) 本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利按除息日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；
- (6) 基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；
- (7) 基金当年收益应先弥补上一年度亏损后，方可进行当年收益分配；
- (8) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年至少分配一次，但若基金合同生效不满 3 个月则可不进行收益分配；
- (9) 法律、法规或监管机构另有规定的，基金管理人在履行适当程序后，将对上述基金收益分配政策进行调整。

#### 7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

无。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

本基金本报告期间无需要说明的会计政策和会计估计变更及差错更正事项。

#### 7.4.6 税项

##### 1. 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

## 2. 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

## 3. 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入，由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴 20%的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]107号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》的规定，自2005年6月13日起，对证券投资基金从上市公司分配取得的股息红利所得，按照财税[2005]102号文规定，扣缴义务人在代扣代缴个人所得税时，减按50%计算应纳税所得额；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号《财政部国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》，自 2008 年 10 月 9 日起暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 12 月 31 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
活期存款	538,341,242.76	446,508,021.17
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	538,341,242.76	446,508,021.17

注：本基金于 2011 年度与 2010 年度均未投资于定期存款。

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 12 月 31 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	4,680,986,685.31	4,001,563,049.35	-679,423,635.96	
债券	交易所市场	118,223,699.93	120,979,702.30	2,756,002.37
	银行间市场	975,083,326.31	980,782,000.00	5,698,673.69
	合计	1,093,307,026.24	1,101,761,702.30	8,454,676.06
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	5,774,293,711.55	5,103,324,751.65	-670,968,959.90	
项目	上年度末 2010 年 12 月 31 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	5,122,014,614.55	5,150,470,106.61	28,455,492.06	
债券	交易所市场	1,008,563,479.75	1,020,111,120.14	11,547,640.39
	银行间市场	606,132,669.88	595,293,000.00	-10,839,669.88
	合计	1,614,696,149.63	1,615,404,120.14	707,970.51
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	6,736,710,764.18	6,765,874,226.75	29,163,462.57	

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末均未持有衍生金融资产和负债。

### 7.4.7.4 买入返售金融资产

#### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券	150,000,000.00	-
合计	150,000,000.00	-

**7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

**7.4.7.5 应收利息**

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 12 月 31 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	85,389.99	57,187.37
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	28,320.71	6,279.46
应收债券利息	10,829,356.03	18,102,698.50
应收买入返售证券利息	8,613.42	-
应收申购款利息	-	-
其他	-	-
合计	10,951,680.15	18,166,165.33

**7.4.7.6 其他资产**

本基金本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

**7.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 12 月 31 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	3,455,551.52	16,494,984.56
银行间市场应付交易费用	10,864.61	6,470.80
合计	3,466,416.13	16,501,455.36

**7.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 12 月 31 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	2,000,000.00	1,500,000.00
应付赎回费	192.58	1,572.71
应交企业债税金	641,052.59	510,955.39
预提审计费	100,000.00	100,000.00
预提信息披露费	300,000.00	300,000.00
预提账户维护费	4,500.00	4,500.00
合计	3,045,745.17	2,417,028.10

**7.4.7.9 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12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	10,992,255,059.83	6,148,966,254.20
本期申购	532,436,426.48	297,833,296.10
本期赎回（以“-”号填列）	-1,014,478,862.59	-567,488,252.98
本期末	10,510,212,623.72	5,879,311,297.32

注：本年申购中包含红利再投资、转入份额及金额，本年赎回中包含转出份额及金额。

**7.4.7.10 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	858,501,057.89	142,479,377.04	1,000,980,434.93
本期利润	-482,404,799.95	-700,132,422.47	-1,182,537,222.42
本期基金份额交易产生的变动数	-32,684,383.45	-11,007,833.01	-43,692,216.46
其中：基金申购款	40,533,693.62	-14,696,610.70	25,837,082.92
基金赎回款	-73,218,077.07	3,688,777.69	-69,529,299.38
本期已分配利润	-	-	-
本期末	343,411,874.49	-568,660,878.44	-225,249,003.95

**7.4.7.11 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12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日
	活期存款利息收入	4,666,708.99
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	264,072.39	251,715.63
其他	-	-
合计	4,930,781.38	4,260,619.96

**7.4.7.12 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12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010 年12月31日
卖出股票成交总额	11,835,460,268.92	24,072,831,554.44
减：卖出股票成本总额	12,205,390,239.61	23,386,449,338.37
买卖股票差价收入	-369,929,970.69	686,382,216.07

#### 7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12 月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31 日
卖出债券（债转股及债券到 期兑付）成交总额	3,106,389,244.82	2,473,190,725.43
减：卖出债券（债转股及债 券到期兑付）成本总额	3,101,400,741.83	2,374,054,761.76
减：应收利息总额	56,065,816.06	51,874,487.41
债券投资收益	-51,077,313.07	47,261,476.26

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间均未持有权证。

#### 7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12 月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31 日
股票投资产生的股利收益	32,747,277.12	32,783,949.08
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	32,747,277.12	32,783,949.08

#### 7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2011年1月1日至2011 年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12 月31日
1. 交易性金融资产	-700,132,422.47	-814,053,288.79
——股票投资	-707,879,128.02	-822,074,852.73
——债券投资	7,746,705.55	8,021,563.94

——资产支持证券投资	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
合计	-700,132,422.47	-814,053,288.79

#### 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2011年1月1日至2011年12月31日	2010年1月1日至2010年12月31日
基金赎回费收入	184,983.85	516,659.62
转换费收入	37,754.70	10,890.76
债券投资手续费返还	-	-
合计	222,738.55	527,550.38

#### 7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2011年1月1日至2011年12月31日	2010年1月1日至2010年12月31日
交易所市场交易费用	35,707,025.68	72,010,913.86
银行间市场交易费用	17,812.50	9,575.00
合计	35,724,838.18	72,020,488.86

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2011年1月1日至2011年12月31日	2010年1月1日至2010年12月31日
审计费用	100,000.00	100,000.00
信息披露费	300,000.00	300,000.00
银行费用	68,462.64	80,577.83
账户维护费	18,000.00	22,500.00
合计	486,462.64	503,077.83

## 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的重大或有事项。

### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金并无须作披露的重大资产负债表日后事项。

## 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
工银瑞信基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
中国工商银行股份有限公司	基金管理人股东、基金代销机构
瑞士信贷	基金管理人股东

注：1、本报告期因基金管理人股东的股权发生转让，中国远洋运输（集团）总公司自 2011 年 11 月 16 日起不再是基金的关联方；

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。

## 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金 2011 年度和 2010 年度均未通过关联方交易单元进行交易。

### 7.4.10.2 关联方报酬

#### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日	2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	97,023,339.14	111,196,426.41
其中：支付销售机构的客户维护费	20,810,132.85	25,355,627.25

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

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}, \text{ 本基金年管理费率为 } 1.5\%$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

2、基金管理费每日计提，按月支付。

**7.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日	2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	16,170,556.58	18,532,737.74

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

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}, \text{ 本基金年托管费率为 } 0.25\%$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

2、基金托管费每日计提，按月支付。

**7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

本期						
2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
-	-	-	-	-	50,000,000.00	4,460.07

本基金 2010 年度未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

**7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况****7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日	2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日
基金合同生效日（2006 年 7 月 13 日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	35,768,133.56	35,768,133.56
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	35,768,133.56	35,768,133.56
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.34%	0.33%

注：1、本基金关联方投资本基金时所适用的费率为本基金基金合同中约定的费率。

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

#### 7.4.10.4.2 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持有本基金。

#### 7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2011年1月1日至2011年12月31日		2010年1月1日至2010年12月31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	538,341,242.76	4,666,708.99	446,508,021.17	4,008,904.33

#### 7.4.10.6 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上述各关联方及托管人股东承销的证券。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 利润分配情况

无

#### 7.4.12 期末（2011年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000776	广发证券	2011年8月25日	2012年08月27日	非公开发行	26.91	21.00	4,500,000	121,095,000.00	94,500,000.00	-
002273	水晶光电	2011年12月22日	2012年12月24日	非公开发行	35.95	32.31	1,100,000	39,545,000.00	35,541,000.00	-
601669	中国水电	2011年9月29日	2012年1月18日	新股未上市	4.50	4.09	3,437,870	15,470,415.00	14,060,888.30	-

### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000816	江淮动力	2011年11月07日	重大事项	5.63	2012年2月27日	6.51	49,444,783	276,610,607.41	278,374,128.29	-

注：本基金因重大事项停牌的股票中包含按指数收益法确定公允价值的长期停牌股票，该类股票估值采用中国证券业协会基金估值小组提供的估值方法，并于 2011 年 12 月 31 日对资产净值和本期净利润的影响均为人民币-69,717,144.03 元。

### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本年末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 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下属的公司治理与风险控制委员会构成，公司治理与风险控制委员会通过督察长和监察稽核人员的工作，掌握整体风险状况并进行决策。公司治理与风险控制委员会负责检查公司业务的内控制度的实施情况，监督公司对相关法律法规和公司制度的执行。

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

#### 7.4.13.2 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。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

##### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

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

##### 7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

长期信用评级	本期末 2011 年 12 月 31 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
AAA	198,720,000.00	400,019,742.80
AAA 以下	285,549,702.30	668,051,377.34
未评级	-	-
合计	484,269,702.30	1,068,071,120.14

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

### 7.4.13.3 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。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除小部分流通受限证券外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

### 7.4.13.4 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。

#### 7.4.13.4.1 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。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

本期末 2011 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	538,341,242.76	-	-	-	-	-	538,341,242.76
结算备付金	57,213,504.31	-	-	-	-	-	57,213,504.31

存出保证金	-	-	-	-	-	5,023,581.67	5,023,581.67
交易性金融资产	-	-488,580,000.00	536,965,702.30	76,216,000.00	4,001,563,049.35	5,103,324,751.65	
买入返售金融资产	150,000,000.00	-	-	-	-	-	150,000,000.00
应收利息	-	-	-	-	-	10,951,680.15	10,951,680.15
应收申购款	-	-	-	-	-	52,860.80	52,860.80
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	745,554,747.07	-488,580,000.00	536,965,702.30	76,216,000.00	4,017,591,171.97	5,864,907,621.34	
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	194,854,234.32	194,854,234.32
应付赎回款	-	-	-	-	-	814,045.06	814,045.06
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	7,427,046.25	7,427,046.25
应付托管费	-	-	-	-	-	1,237,841.04	1,237,841.04
应付交易费用	-	-	-	-	-	3,466,416.13	3,466,416.13
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	3,045,745.17	3,045,745.17
负债总计	-	-	-	-	-	210,845,327.97	210,845,327.97
利率敏感度缺口	745,554,747.07	-488,580,000.00	536,965,702.30	76,216,000.00	3,806,745,844.00	5,654,062,293.37	
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	446,508,021.17	-	-	-	-	-	446,508,021.17
结算备付金	16,310,044.50	-	-	-	-	-	16,310,044.50
存出保证金	-	-	-	-	-	5,210,184.31	5,210,184.31
交易性金融资产	-	-604,121,648.00	540,915,292.84	470,367,179.30	5,150,470,106.61	6,765,874,226.75	
应收利息	-	-	-	-	-	18,166,165.33	18,166,165.33
应收申购款	-	-	-	-	-	1,106,495.16	1,106,495.16
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	462,818,065.67	-604,121,648.00	540,915,292.84	470,367,179.30	5,174,952,951.41	7,253,175,137.22	
负债	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	71,503,718.40	71,503,718.40
应付赎回款	-	-	-	-	-	2,246,231.58	2,246,231.58
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	9,051,441.14	9,051,441.14
应付托管费	-	-	-	-	-	1,508,573.51	1,508,573.51
应付交易费用	-	-	-	-	-	16,501,455.36	16,501,455.36
其他负债	-	-	-	-	-	2,417,028.10	2,417,028.10
负债总计	-	-	-	-	-	103,228,448.09	103,228,448.09
利率敏感度缺口	462,818,065.67	-604,121,648.00	540,915,292.84	470,367,179.30	5,071,724,503.32	7,149,946,689.13	

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。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1、该利率敏感性分析基于本基金报表日的利率风险状况；
----	----------------------------

	2、假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他变量不变；		
	3、此项影响并未考虑管理层为降低利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 12 月 31 日）	上年度末（2010 年 12 月 31 日）
	利率增加 25 基准点	-6,007,570.63	-6,126,667.68
	利率减少 25 基准点	6,069,785.03	6,196,770.09

#### 7.4.13.4.2 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市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的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市场价格风险，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。

##### 7.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

项目	本期末 2011 年 12 月 31 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	4,001,563,049.35	70.77	5,150,470,106.61	72.04
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	1,101,761,702.30	19.49	1,615,404,120.14	22.59
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	5,103,324,751.65	90.26	6,765,874,226.75	94.63

注：1、本基金投资组合中股票投资比例范围为基金资产净值的 40%-80%；债券及其它短期金融工具占基金资产净值的比例为 20%-60%。

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值可能有尾差

##### 7.4.13.4.2.2 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 系数是根据组合在过去一个年度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12月31日）	上年度末（2010年12月31日）
	业绩比较基准增加 5%	311,135,318.08	423,485,577.39
	业绩比较基准减少 5%	-311,135,318.08	-423,485,577.39

#### 7.4.14 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，本基金并无须作说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	4,001,563,049.35	68.23
	其中：股票	4,001,563,049.35	68.23
2	固定收益投资	1,101,761,702.30	18.79
	其中：债券	1,101,761,702.30	18.79
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	150,000,000.00	2.56
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	595,554,747.07	10.15
6	其他各项资产	16,028,122.62	0.27
7	合计	5,864,907,621.34	100.00

注：由于四舍五入的原因公允价值占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	17,805,582.48	0.31
B	采掘业	40,972,255.28	0.72
C	制造业	1,833,162,318.07	32.42
C0	食品、饮料	752,105,040.38	13.30
C1	纺织、服装、皮毛	40,369,080.60	0.71
C2	木材、家具	22,173,926.04	0.39
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	7,924,000.00	0.14
C5	电子	185,026,356.31	3.27

C6	金属、非金属	3,102,261.66	0.05
C7	机械、设备、仪表	587,862,261.82	10.40
C8	医药、生物制品	234,599,391.26	4.15
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	462,009,116.86	8.17
E	建筑业	14,060,888.30	0.25
F	交通运输、仓储业	4,690,836.00	0.08
G	信息技术业	36,444,796.40	0.64
H	批发和零售贸易	472,525,084.38	8.36
I	金融、保险业	463,041,128.54	8.19
J	房地产业	155,750,542.00	2.75
K	社会服务业	453,546,741.96	8.02
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	47,553,759.08	0.84
	合计	4,001,563,049.35	70.77

注：由于四舍五入的原因公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600809	山西汾酒	9,394,016	593,138,170.24	10.49
2	000939	凯迪电力	40,746,985	431,918,041.00	7.64
3	000816	江淮动力	49,444,783	278,374,128.29	4.92
4	300015	爱尔眼科	10,984,678	274,067,716.10	4.85
5	600763	通策医疗	7,835,592	165,174,279.36	2.92
6	000501	鄂武商A	9,021,876	137,583,609.00	2.43
7	600993	马应龙	6,804,389	117,647,885.81	2.08
8	000776	广发证券	5,545,797	116,461,737.00	2.06
9	600036	招商银行	9,561,864	113,499,325.68	2.01
10	600778	友好集团	11,471,044	111,039,705.92	1.96
11	000963	华东医药	3,899,573	103,806,633.26	1.84
12	600519	贵州茅台	459,850	88,889,005.00	1.57
13	000926	福星股份	10,367,148	73,399,407.84	1.30
14	600340	华夏幸福	4,506,744	72,333,241.20	1.28
15	601318	中国平安	2,099,892	72,320,280.48	1.28
16	002024	苏宁电器	7,509,055	63,376,424.20	1.12
17	000566	海南海药	3,023,009	61,336,852.61	1.08
18	000061	农产品	5,086,880	56,718,712.00	1.00
19	601607	上海医药	5,019,373	55,614,652.84	0.98

20	300207	欣旺达	2,887,900	46,783,980.00	0.83
21	600266	北京城建	3,748,039	46,438,203.21	0.82
22	002273	水晶光电	1,418,211	45,822,397.41	0.81
23	000700	模塑科技	8,172,024	44,700,971.28	0.79
24	000049	德赛电池	1,876,224	39,044,221.44	0.69
25	601601	中国太保	1,998,259	38,386,555.39	0.68
26	002029	七匹狼	914,304	32,274,931.20	0.57
27	002456	欧菲光	1,611,151	29,854,628.03	0.53
28	600837	海通证券	4,000,000	29,640,000.00	0.52
29	600310	桂东电力	2,253,177	29,246,237.46	0.52
30	000800	一汽轿车	3,151,383	27,889,739.55	0.49
31	600770	综艺股份	1,660,662	26,454,345.66	0.47
32	600100	同方股份	2,999,903	26,399,146.40	0.47
33	600499	科达机电	2,869,874	26,288,045.84	0.46
34	000876	新希望	1,549,843	25,959,870.25	0.46
35	000729	燕京啤酒	1,881,111	25,376,187.39	0.45
36	600879	航天电子	3,068,222	25,190,102.62	0.45
37	601166	兴业银行	2,000,000	25,040,000.00	0.44
38	002489	浙江永强	1,181,979	22,173,926.04	0.39
39	600690	青岛海尔	2,443,018	21,816,150.74	0.39
40	002244	滨江集团	2,999,907	21,269,340.63	0.38
41	000652	泰达股份	4,999,861	21,099,413.42	0.37
42	600060	海信电器	1,699,914	20,194,978.32	0.36
43	600030	中信证券	2,034,181	19,751,897.51	0.35
44	000527	美的电器	1,499,970	18,359,632.80	0.32
45	002069	獐子岛	724,983	17,805,582.48	0.31
46	000338	潍柴动力	499,957	15,748,645.50	0.28
47	601777	力帆股份	2,279,109	15,361,194.66	0.27
48	601818	光大银行	5,000,000	14,400,000.00	0.25
49	300144	宋城股份	565,405	14,304,746.50	0.25
50	601669	中国水电	3,437,870	14,060,888.30	0.25
51	601998	中信银行	3,473,700	14,033,748.00	0.25
52	600300	维维股份	3,399,950	13,089,807.50	0.23
53	601898	中煤能源	1,449,971	13,064,238.71	0.23
54	601088	中国神华	500,000	12,665,000.00	0.22
55	000718	苏宁环球	2,239,208	11,733,449.92	0.21
56	300219	鸿利光电	667,883	10,953,281.20	0.19
57	002266	浙富股份	626,945	10,620,448.30	0.19
58	000651	格力电器	599,932	10,372,824.28	0.18

59	601788	光大证券	998,380	10,183,476.00	0.18
60	601899	紫金矿业	2,000,000	7,640,000.00	0.14
61	600439	瑞贝卡	1,119,144	7,442,307.60	0.13
62	600015	华夏银行	632,500	7,102,975.00	0.13
63	002528	英飞拓	392,497	5,867,830.15	0.10
64	000848	承德露露	400,000	5,652,000.00	0.10
65	002153	石基信息	200,000	5,106,000.00	0.09
66	600367	红星发展	400,000	4,948,000.00	0.09
67	600279	重庆港九	682,800	4,690,836.00	0.08
68	600343	航天动力	384,436	4,332,593.72	0.08
69	002155	辰州矿业	199,951	4,013,016.57	0.07
70	600118	中国卫星	194,900	3,975,960.00	0.07
71	600028	中国石化	500,000	3,590,000.00	0.06
72	600362	江西铜业	141,462	3,102,261.66	0.05
73	600418	江淮汽车	499,930	2,979,582.80	0.05
74	600096	云天化	200,000	2,976,000.00	0.05
75	600999	招商证券	218,186	2,221,133.48	0.04
76	000616	亿城股份	549,954	1,759,852.80	0.03
77	000656	金科股份	97,482	1,150,287.60	0.02
78	600403	大有能源	39,000	963,690.00	0.02
79	601199	江南水务	62,860	844,838.40	0.01
80	002485	希努尔	29,901	651,841.80	0.01

报告期末本基金持有的股票“山西汾酒”市值占净值比超 10%是因市场波动引起的被动超标，投资管理人已按相关法规要求及时进行调整。

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000939	凯迪电力	646,469,096.47	9.04
2	600809	山西汾酒	497,977,002.40	6.96
3	000039	中集集团	435,496,722.87	6.09
4	601318	中国平安	376,446,840.16	5.27
5	000776	广发证券	303,569,458.21	4.25
6	002008	大族激光	298,992,933.73	4.18
7	601166	兴业银行	272,936,761.90	3.82

8	600036	招商银行	260,093,344.99	3.64
9	000002	万科A	221,261,333.84	3.09
10	000061	农产品	219,917,105.47	3.08
11	300015	爱尔眼科	203,039,741.64	2.84
12	000566	海南海药	188,633,105.57	2.64
13	601857	中国石油	176,070,068.31	2.46
14	000501	鄂武商A	174,324,640.56	2.44
15	000926	福星股份	167,116,236.69	2.34
16	600383	金地集团	161,823,026.64	2.26
17	600887	伊利股份	157,692,421.44	2.21
18	000528	柳工	156,735,898.46	2.19
19	600030	中信证券	155,844,355.04	2.18
20	601601	中国太保	145,534,656.44	2.04

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。

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	000039	中集集团	445,045,034.83	6.22
2	600809	山西汾酒	438,518,559.70	6.13
3	600770	综艺股份	316,817,755.32	4.43
4	601318	中国平安	304,967,033.24	4.27
5	601288	农业银行	262,895,400.29	3.68
6	601166	兴业银行	258,192,268.36	3.61
7	601998	中信银行	236,468,074.71	3.31
8	600418	江淮汽车	227,033,243.60	3.18
9	000528	柳工	225,653,759.41	3.16
10	000002	万科A	221,801,400.18	3.10
11	002008	大族激光	198,325,311.16	2.77
12	601088	中国神华	194,461,167.43	2.72
13	000786	北新建材	190,369,002.22	2.66
14	600425	青松建化	174,315,563.72	2.44
15	600348	阳泉煤业	165,701,862.07	2.32
16	000776	广发证券	163,545,390.87	2.29

17	601857	中国石油	161,323,251.11	2.26
18	600887	伊利股份	158,154,555.68	2.21
19	600383	金地集团	153,887,729.33	2.15
20	600036	招商银行	149,236,332.64	2.09
21	600188	兖州煤业	144,098,081.08	2.02
22	600362	江西铜业	143,412,853.21	2.01

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。

### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	11,764,362,310.37
卖出股票收入（成交）总额	11,835,460,268.92

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。

### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	289,860,000.00	5.13
3	金融债券	327,632,000.00	5.79
	其中：政策性金融债	327,632,000.00	5.79
4	企业债券	245,645,702.30	4.34
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	238,624,000.00	4.22
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	1,101,761,702.30	19.49

注：由于四舍五入的原因公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	0982153	09 电网 MTN3	2,000,000	198,720,000.00	3.51
2	1101082	11 央行票据 82	2,000,000	193,220,000.00	3.42
3	110317	11 进出 17	1,500,000	151,815,000.00	2.69
4	110253	11 国开 53	1,200,000	125,112,000.00	2.21

5	1101094	11 央行票据 94	1,000,000	96,640,000.00	1.71
---	---------	------------	-----------	---------------	------

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券

### 8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 8.9 投资组合报告附注

**8.9.1** 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

**8.9.2** 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 8.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	5,023,581.67
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	10,951,680.15
5	应收申购款	52,860.80
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	16,028,122.62

### 8.9.4 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。

### 8.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	000816	江淮动力	278,374,128.29	4.92	重大事项
2	000776	广发证券	94,500,000.00	1.67	非公开发行

### 8.9.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 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
366,059	28,711.80	1,134,443,894.41	10.79%	9,375,768,729.31	89.21%

### 9.2 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	1,087,859.81	0.01%

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2006年7月13日）基金份额总额	8,369,914,482.23
本报告期期初基金份额总额	10,992,255,059.83
本报告期基金总申购份额	532,436,426.48
减：本报告期基金总赎回份额	1,014,478,862.59
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	10,510,212,623.72

注：1、总申购份额含红利再投、转换入份额；

2、总赎回份额含转换出份额。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 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：

(1) 公司法定代表人变更为李晓鹏先生，并于2011年2月24日进行披露；

(2) 因公司第二届董事会任期届满，经公司股东会审议通过，选举李晓鹏先生、Neil Harvey 先生、郭特华女士、库三七先生、朱文信先生、王莹女士担任公司第三届董事会董事，刘国恩先生、孙祁祥女士、Jane DeBevoise 女士担任第三届董事会独立董事。赵跃女士、陈晓燕女士、蔡昀先生、David Peter Walker 先生、牛大鸿先生不再担任本公司董事职务，公司已于 2011 年 12 月 10 日进行披露；

(3) 因任期届满，肖在翔先生不再担任公司副总经理，由库三七先生担任公司副总经理，公司已于 2011 年 12 月 15 日进行披露。

## 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。本基金托管人 2011 年 10 月 24 日发布任免通知，聘任张军红为中国建设银行投资托管服务部副总经理。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

无。

### 11.4 基金投资策略的改变

无

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内应支付给安永华明会计师事务所审计费用十万元整，该审计机构自基金合同生效日起向本基金提供审计服务。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

无

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 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	佣金	占当期佣金总量的比例	

			例			
广发证券	16,067,300,959.19	25.96%	5,157,185.55	26.49%	-	-
中银国际	13,361,178,199.30	14.38%	2,730,978.36	14.03%	-	-
中信建投	12,932,260,028.90	12.55%	2,492,414.79	12.80%	-	-
齐鲁证券	12,598,064,441.98	11.12%	2,110,947.42	10.84%	-	-
国开证券	12,142,601,129.53	9.17%	1,821,196.48	9.36%	-	-
北京高华	11,958,162,899.54	8.38%	1,591,018.57	8.17%	-	-
申银万国	11,239,534,995.50	5.30%	1,053,596.67	5.41%	-	-
国金证券	11,153,157,807.08	4.93%	936,948.41	4.81%	-	-
长江证券	1 914,554,657.57	3.91%	743,082.16	3.82%	-	-
山西证券	1 567,167,313.29	2.43%	460,824.49	2.37%	-	-
中信证券	1 434,028,559.22	1.86%	368,922.03	1.90%	-	-
国泰君安	1 -	-	-	-	-	-
招商证券	1 -	-	-	-	-	-
宏源证券	1 -	-	-	-	-	-
光大证券	1 -	-	-	-	-	-
中金公司	1 -	-	-	-	-	-

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。

## 3. 证券公司席位的变更情况

在报告期内本基金新增国开证券有限责任公司的 61139 上海交易单元，广发证券股份有限公司的 13440 上海交易单元；宏源证券股份有限公司的 257100 深圳交易单元。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
广发证券	331,313,584.82	20.05%	600,000,000.00	3.54%	-	-
中银国际	81,552,782.81	4.94%	-	-	-	-
中信建投	243,034,266.77	14.71%	180,000,000.00	1.06%	-	-
齐鲁证券	517,290.00	0.03%	49,999,000.00	0.30%	-	-
国开证券	194,392,105.46	11.77%	5,110,000,000.00	30.17%	-	-
北京高华	41,301,057.97	2.50%	-	-	-	-
申银万国	659,254,091.60	39.90%	11,000,000,000.00	64.94%	-	-
国金证券	2,031,180.00	0.12%	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	98,797,613.31	5.98%	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-

招商证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
中金	-	-	-	-	-	-

## 11.8 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	工银瑞信精选平衡混合型证券投资基金 2010 年第 4 季度报告	三大报、公司网站	2011 年 1 月 24 日
2	江苏江淮动力股份有限公司简式股东权益变动报告书	三大报、公司网站	2011 年 2 月 19 日
3	工银瑞信精选平衡混合型证券投资基金 2010 年度报告	三大报、公司网站	2011 年 3 月 26 日
4	工银瑞信基金管理有限公司关于变更基金经理的公告	三大报、公司网站	2011 年 4 月 11 日
5	工银瑞信精选平衡混合型证券投资基金 2011 年第 1 季度报告	三大报、公司网站	2011 年 4 月 23 日
6	工银瑞信精选平衡混合型证券投资基金 2011 年第 2 季度报告	三大报、公司网站	2011 年 7 月 19 日
7	工银瑞信基金管理有限公司关于旗下基金申购广发证券非公开发行股票的公告	三大报、公司网站	2011 年 8 月 26 日
8	工银瑞信精选平衡混合型证券投资基金 2011 年半年度报告	三大报、公司网站	2011 年 8 月 29 日
9	工银瑞信精选平衡混合型证券投资基金 2011 年第 3 季度报告	三大报、公司网站	2011 年 10 月 26 日
10	工银瑞信基金管理有限公司关于旗下基金申购水晶光电非公开发行股票的公告	三大报、公司网站	2011 年 12 月 23 日

注：三大报包括中国证券报、证券时报、上海证券报。

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

- 1、2011年10月28日, 托管人中国建设银行股份有限公司发布关于董事长辞任的公告, 根据国家金融工作的需要, 郭树清先生已向中国建设银行股份有限公司 (“本行”) 董事会 (“董事会”) 提出辞呈, 请求辞去本行董事长、执行董事等职务。根据《中华人民共和国公司法》等相关法律法规和本行章程的规定, 郭树清先生的辞任自辞呈送达本行董事会之日起生效。
- 2、2012年1月16日, 托管人中国建设银行股份有限公司发布关于董事长任职的公告, 自2012 年1 月 16 日起, 王洪章先生就任本行董事长、执行董事。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

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

### 13.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的办公场所。

### 13.3 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)

