

**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**  
**报告送出日期:2009年4月20日**

**§1 重要提示**

基金管理人的董事会及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责任。

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2009年04月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失,投资者自行承担投资风险,基金管理人不承担投资损失,投资者自行承担投资风险。

本基金的过往业绩并不预示其未来表现,投资有风险,投资者作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告财务数据截止至2009年3月31日。

**§2 基金产品概况**

基金名称:	工银货币
交易代码:	482002
基金运作方式:	契约型开放式
基金合同生效日:	2006年03月20日
报告期末基金份额总额:	14,256,951,195.45份
投资目标:	力求保证基金资产安全和良好流动性的前提下,获得超过业绩比较基准的收益。
投资策略:	在确定的利率策略和期限结构,及资产配置策略下,通过短期货币市场工具的投资来获取稳定的收益。
业绩比较基准:	本基金业绩比较基准为:1年期定期存款利率(税后),即1年期定期存款利率+0.5%月复利(税后)。
风险收益特征:	本基金为货币市场基金,在所有证券投资基金中,是风险相对较低的基金。
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

**§3 主要财务指标和基金净值表现**

单位:人民币元	
主要财务指标	报告期(2009年01月01日-2009年03月31日)
1.本期已实现收益	48,292,105.25
2.本期利润	48,292,105.25
3.期末基金份额净值	14.256,951,195.45

**§4 基金业绩表现**

阶段	净值增长(%)	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
过去三个月	0.2440%	0.0049%	0.4882%	0.0000%	-0.2442%	0.0049%

注:本基金业绩表现以同期业绩比较基准为基准进行评价。

注:本基金自成立以来基金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

注:本基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起2个月内建仓,截至报告日本基金的各项投资比例已达到基金合同第三节(三)投资范围、(四)投资组合比例中规定予以约定的范围。本基金投资组合的平均存续期限在每个交易日均控制在180天以内,本基金投资组合中,债券类资产的市值占基金资产净值的比例不低于基金资产净值的20%。法律法规规定的其他投资比例。

# 工银瑞信货币市场基金

## 2009年第一季度报告

**§4 管理人报告**

姓名	职务	任本基金的基金经理期限	证券从业年限	说明
杜涛	基金经理	2006-9-21	12	中国籍,毕业于复旦大学,获工商管理硕士学位,1997年7月至2002年10月,任职于长城证券有限责任公司,担任债券基金基金经理。2002年10月至2003年6月,任职于工银瑞信基金管理有限公司,担任工银货币基金经理。2003年6月至2005年5月,担任招商货币基金经理。2005年5月13日至2006年9月21日,担任招商货币基金经理。2006年9月21日至今,担任工银瑞信货币市场基金基金经理。2007年5月11日至今,担任工银瑞信货币市场基金基金经理。2008年6月担任工银瑞信货币市场基金基金经理。

4.1 报告期内基金投资策略和运作情况说明

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,恪尽职守,勤勉尽责的贯彻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,实现基金份额持有人的利益。

4.2 报告期内基金管理人投资策略和运作情况说明

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,恪尽职守,勤勉尽责的贯彻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,实现基金份额持有人的利益。

4.3 公平交易专项说明

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》、《证券投资基金管理暂行办法》等有关法律法规,制定了《公平交易管理制度》,对证券投资基金公平交易管理制度进行了明确具体的规定,并定期对投资组合持仓的证券价格和市场价格的差异,进行跟踪分析,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,本公司对满足投资条件且同一证券申购交易需求的基金投资组合,采用了系统中公平交易系统进行申报,实现了公平交易,没有出现异常交易的情况。且本基金及基金与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关联交易及交叉交易。

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

本基金管理人报告期内没有发生风格相似的投资组合。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金报告期内没有发生异常交易的情况。

4.3.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.3.4.1 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

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,恪尽职守,勤勉尽责的贯彻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,实现基金份额持有人的利益。

4.3.4.2 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

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,恪尽职守,勤勉尽责的贯彻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,实现基金份额持有人的利益。

4.3.4.3 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

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,恪尽职守,勤勉尽责的贯彻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,实现基金份额持有人的利益。

4.3.4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

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,恪尽职守,勤勉尽责的贯彻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,实现基金份额持有人的利益。

4.3.4.5 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

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,恪尽职守,勤勉尽责的贯彻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,实现基金份额持有人的利益。

4.3.4.6 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

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,恪尽职守,勤勉尽责的贯彻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,实现基金份额持有人的利益。

4.3.4.7 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

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,恪尽职守,勤勉尽责的贯彻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,实现基金份额持有人的利益。

4.3.4.8 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

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,恪尽职守,勤勉尽责的贯彻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,实现基金份额持有人的利益。

4.3.4.9 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

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,恪尽职守,勤勉尽责的贯彻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,实现基金份额持有人的利益。

4.3.4.10 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

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,恪尽职守,勤勉尽责的贯彻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,实现基金份额持有人的利益。

4.3.4.11 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

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,恪尽职守,勤勉尽责的贯彻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,实现基金份额持有人的利益。

4.3.4.12 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

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,恪尽职守,勤勉尽责的贯彻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,实现基金份额持有人的利益。

4.3.4.13 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

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,恪尽职守,勤勉尽责的贯彻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,实现基金份额持有人的利益。

4.3.4.14 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

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,恪尽职守,勤勉尽责的贯彻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,实现基金份额持有人的利益。

4.3.4.15 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

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,恪尽职守,勤勉尽责的贯彻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,实现基金份额持有人的利益。

4.3.4.16 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

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,恪尽职守,勤勉尽责的贯彻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,实现基金份额持有人的利益。

4.3.4.17 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

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,恪尽职守,勤勉尽责的贯彻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,实现基金份额持有人的利益。

4.3.4.18 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

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,恪尽职守,勤勉尽责的贯彻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,实现基金份额持有人的利益。

4.3.4.19 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

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,恪尽职守,勤勉尽责的贯彻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,实现基金份额持有人的利益。

4.3.4.20 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

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,恪尽职守,勤勉尽责的贯彻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,实现基金份额持有人的利益。

4.3.4.21 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

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,恪尽职守,勤勉尽责的贯彻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,实现基金份额持有人的利益。

4.3.4.22 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

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,恪尽职守,勤勉尽责的贯彻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,实现基金份额持有人的利益。

注:由于前五人的原因,本基金资产净值比例之和与合计可能有误差。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	0801092	08央行票据 92	16,970,000	1,689,229,516.97	11.85
2	0801106	08央行票 106	15,400,000	1,528,992,632.06	10.72
3	0881257	08中石油 CP101	13,300,000	1,327,955,047.55	9.31
4	0801052	08央行票据 52	7,700,000	789,100,365.13	5.53
5	0981204	09央行票 CP101	7,730,000	773,213,764.91	5.42
6	0881258	08中石油 CP101	7,600,000	761,468,606.96	5.34
7	0801049	08央行票 49	7,300,000	729,407,982.87	5.11
8	0881210	08央行票 CP101	7,000,000	703,207,354.79	4.93
9	0881249	08央行票 CP103	6,800,000	677,721,877.21	4.75
10	0801095	08央行票 95	6,000,000	596,581,219.50	4.18

注:以上债券投资的公允价值包括债券应计利息。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	存出保证金	-	-	-
2	应收证券清算款	-	358,564,114.79	2.53
3	应收利息	-	111,753,572.20	0.79
4	应收申购款	-	18,361,520.83	0.13
5	其他应收款	-	-	-
6	待摊费用	-	-	-
7	其他	-	-	-
8	合计	-	655,679,207.82	4.65

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有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、处罚的情况。

5.8.2 本基金持有的前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.8.3 衍生品投资

5.8.3.1 报告期内,本基金持有的衍生品投资情况

**§6 开放式基金份额变动**

报告期初基金份额总额	37,584,799,562.40
报告期基金总申购份额	41,828,726,074.92
报告期基金总赎回份额	65,156,574,441.87
报告期末基金份额总额	14,256,951,195.45

7.1 备查文件目录

1. 中国证监会核准工银瑞信货币市场基金设立的文件;
2. 工银瑞信货币市场基金基金合同;
3. 工银瑞信货币市场基金托管协议;
4. 基金管理人业务资格和营业场所证明;
5. 基金托管人业务资格和营业场所证明;
6. 报告期内基金管理人及托管人披露的各项公告;
7. 专项审计报告;
8. 基金管理人或基金托管人处。

**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**  
**报告送出日期:2009年4月20日**

**§1 重要提示**

基金管理人的董事会及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责任。

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2009年4月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失,投资者自行承担投资风险,基金管理人不承担投资损失,投资者自行承担投资风险。

本基金的过往业绩并不预示其未来表现,投资有风险,投资者作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告财务数据截止至2009年3月31日。

**§2 基金产品概况**

基金名称:	工银大盘蓝筹
交易代码:	481008
基金运作方式:	契约型开放式
基金合同生效日:	2008年08月04日
报告期末基金份额总额:	671,664,505.03份
投资目标:	通过投资大盘蓝筹型股票,追求基金资产长期稳定的增值和收益,在合理风险前提下,力争使基金实现超越业绩比较基准的超额收益。
投资策略:	本基金的投资主要集中于大盘蓝筹股票,投资于大盘蓝筹股票的行业在股票市场中具有领先地位,业绩优良,公司治理良好,公司在所属行业处于领先地位。蓝筹股一般具有较好的分红记录,在宏观经济不景气时,蓝筹基金是系统化、结构化的投资组合,能够规避选股风险,公司治理良好,对业绩优秀、公司财务良好,政策利好评估、组合和估值优化等优势,选择具有投资价值的大盘蓝筹股票,构建投资组合。
业绩比较基准:	80%沪深300指数收益率+20%*上证国债指数收益率
风险收益特征:	预期收益及风险水平高于货币型基金和混合型基金,在股票型基金中属于中等风险水平的投资品种。
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

**§3 主要财务指标和基金净值表现**

单位:人民币元	
主要财务指标	报告期(2009年01月01日-2009年03月31日)
1.本期已实现收益	91,981,975.72
2.本期利润	213,468,219.14
3.期末基金份额净值	671,664,505.03
4.期末基金份额净值	802,101,743.09
5.期末基金份额净值	1.194

**§4 基金业绩表现**

阶段	净值增长(%)	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
过去三个月	23.73%	2.01%	20.43%	1.86%	-5.90%	0.15%

注:本基金业绩表现以同期业绩比较基准为基准进行评价。

注:本基金自成立以来基金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

注:本基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起2个月内建仓,截至报告日本基金的各项投资比例已达到基金合同第三节(三)投资范围、(四)投资组合比例中规定予以约定的范围。本基金投资组合的平均存续期限在每个交易日均控制在180天以内,本基金投资组合中,债券类资产的市值占基金资产净值的比例不低于基金资产净值的20%。法律法规规定的其他投资比例。

# 工银瑞信大盘蓝筹股票型证券投资基金

## 2009年第一季度报告

**§4 管理人报告**

姓名	职务	任本基金的基金经理期限	证券从业年限	说明
陈宇虹	基金经理	2008-8-4	12	中国籍,毕业于中南财经政法大学,获博士学位,曾任招商证券分析师,2008年8月至2009年2月,任职于招商证券,担任招商大盘蓝筹基金经理。2008年8月,担任工银瑞信大盘蓝筹基金经理。2008年8月4日至今,担任工银瑞信大盘蓝筹基金经理。

4.1 报告期内基金投资策略和运作情况说明

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,恪尽职守,勤勉尽责的贯彻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,实现基金份额持有人的利益。

4.2 报告期内基金管理人投资策略和运作情况说明

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,恪尽职守,勤勉尽责的贯彻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,实现基金份额持有人的利益。

4.3 公平交易专项说明

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》、《证券投资基金管理暂行办法》等有关法律法规,制定了《公平交易管理制度》,对证券投资基金公平交易管理制度进行了明确具体的规定,并定期对投资组合持仓的证券价格和市场价格的差异,进行跟踪分析,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,本公司对满足投资条件且同一证券申购交易需求的基金投资组合,采用了系统中公平交易系统进行申报,实现了公平交易,没有出现异常交易的情况。且本基金及基金与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关联交易及交叉交易。

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

本基金管理人报告期内没有发生风格相似的投资组合。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金报告期内没有发生异常交易的情况。

4.3.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.3.4.1 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

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,恪尽职守,勤勉尽责的贯彻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,实现基金份额持有人的利益。

4.3.4.2 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

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,恪尽职守,勤勉尽责的贯彻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,实现基金份额持有人的利益。

4.3.4.3 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

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,恪尽职守,勤勉尽责的贯彻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,实现基金份额持有人的利益。

4.3.4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

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,恪尽职守,勤勉尽责的贯彻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,实现基金份额持有人的利益。

4.3.4.5 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

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,恪尽职守,勤勉尽责的贯彻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,实现基金份额持有人的利益。

4.3.4.6 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

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,恪尽职守,勤勉尽责的贯彻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,实现基金份额持有人的利益。

4.3.4.7 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

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,恪尽职守,勤勉尽责的贯彻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,实现基金份额持有人的利益。

4.3.4.8 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

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,恪尽职守,勤勉尽责的贯彻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,实现基金份额持有人的利益。

4.3.4.9 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

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,恪尽职守,勤勉尽责的贯彻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,实现基金份额持有人的利益。

4.3.4.10 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

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,恪尽职守,勤勉尽责的贯彻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,实现基金份额持有人的利益。

4.3.4.11 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

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,恪尽职守,勤勉尽责的贯彻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,实现基金份额持有人的利益。

4.3.4.12 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

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,恪尽职守,勤勉尽责的贯彻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,实现基金份额持有人的利益。

4.3.4.13 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

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,恪尽职守,勤勉尽责的贯彻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,实现基金份额持有人的利益。

注:由于前五人的原因,本基金资产净值比例之和与合计可能有误差。

5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600318 中国中免	1,000,000	70,399,000.00	8.78
2	600135 乐视网	666,214	38,497,047.84	4.80
3	601601 中国中冶	2,140,469	35,917,069.82	4.48
4	600050 中国联通	5,817,696	33,568,105.92	4.19
5	000335 乐视网	1,587,081	32,080,745.87	3.99
6	601169 兴业银行	2,325,263	26,577,277.07	3.31
7	600166 申能股份	1,100,000	25,278,000.00	3.15
8	000335 乐视网	1,371,660	23,052,260.40	2.87
9	600056 蓝色光标	2,409,800	24,773,566.40	3.09
10	600820 申能股份	900,000	22,923,000.00	2.86

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	0801092	08央行票 92	500,000	48,585,000.00	6.06

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有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、处罚的情况。

5.8.2 本基金持有的前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.8.3 衍生品投资

5.8.3.1 报告期内,本基金持有的衍生品投资情况

**§6 开放式基金份额变动**

报告期初基金份额总额	1,095,918,699.21
报告期基金总申购份额	159,525,534.47
报告期基金总赎回份额	583,779,718.65
报告期末基金份额总额	671,664,505.03

7.1 备查文件目录

1. 中国证监会核准工银瑞信大盘蓝筹股票型证券投资基金设立的文件;
2. 工银瑞信大盘蓝筹股票型证券投资基金基金合同;
3. 工银瑞信大盘蓝筹股票型证券投资基金托管协议;
4. 基金管理人业务资格和营业场所证明;
5. 基金托管人业务资格和营业场所证明;
6. 报告期内基金管理人及托管人披露的各项公告;
7. 专项审计报告;
8. 基金管理人或基金托管人处。