# 工银瑞信精选平衡混合型证券投资基金

## 2009 第四季度报告

2009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**
**报告送出日期:2010年01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2010年1月18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。

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。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期为2009年10月1日起至12月31日止。

### §2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 工银精选平衡混合 |
| 交易代码 | 483003 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2006年07月13日 |
| 报告期末基金份额总额 | 10,925,180,282.62份 |
| 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 |
| 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

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

| 主要财务指标 | 报告期(2009年10月01日-2009年12月31日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | 304,704,620.99 |
| 2.本期利润 | 1,196,553,202.02 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.1068 |
| 4.期末基金资产净值 | 8,360,615,554.84 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.7653 |

注:1、上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.所列数据截止到2009年12月31日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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 | 净值增长率① | 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 | 15.88% | 1.29% | 11.43% | 1.06% | 4.45% | 0.23% |

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

注:本基金合同于2006年7月13日生效,截至报告期末本基金合同生效已满一年。截至报告日本基金的各项投资比例已达到基金合同第十二条(二)投资范围、(七)投资组合限制与禁止行为中规定的各项比例。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%,法律法规及本基金合同规定的其他投资比例限制。

### §4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 司晓晨 | 研究部副总监,本基金的基金经理 | 2007年11月12日 | - | 10 | 中国籍,毕业于中国人民银行研究生部,获经济学硕士学位。1999年7月至2005年7月,任职于华夏基金管理有限公司,1999年7月至2000年12月担任研发部高级经理,2001年1月至2003年10月担任基金管理部分析师;2003年11月至2005年7月担任基金经理助理。2005年7月至今,任职于工银瑞信基金管理有限公司,担任高级研究员。2007年11月12日至今,兼任工银瑞信精选平衡基金基金经理。2008年6月起担任研发部副总监。 |
| 曲丽 | 本基金的基金经理 | 2007-11-12 | - | 8 | 中国籍,毕业于清华大学经济管理学院技术经济专业,获管理学硕士学位。2001年5月至2006年12月,任职于华夏证券研究发展部,2005年华夏证券有限公司重组更名为中信建投证券有限公司,担任资深分析师。2007年1月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。2007年11月12日至2009年11月17日,兼任工银瑞信精选平衡基金基金经理。2009年11月18日至今任职于权益投资部,担任工银瑞信精选平衡基金基金经理。 |

4.2 管理人对投资期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 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》、《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

本基金本报告期没有出现异常交易的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

截止报告期末,本基金份额累计净值为1.9955元。本报告期份额净值增长率为15.88%,同期业绩比较基准增长率为11.43%,高于比较基准4.45个百分点。

### §5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产的比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | 6,503,921,069.35 | 77.35 |
| | 其中:股票 | 6,503,921,069.35 | 77.35 |
| 2 | 固定收益投资 | 1,711,668,063.74 | 20.36 |
| | 其中:债券 | 1,711,668,063.74 | 20.36 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 4 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 5 | 银行存款和结算备付金合计 | 168,150,033.83 | 2.00 |
| 6 | 其他资产 | 24,324,003.34 | 0.29 |
| 7 | 合计 | 8,408,063,170.26 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| A | 农、林、牧、渔业 | 160,879,026.26 | 1.92 |
| B | 采掘业 | 500,569,089.31 | 5.99 |
| C | 制造业 | 2,335,404,436.69 | 27.93 |
| C0 | 食品、饮料 | 8,235,043.51 | 0.10 |
| C1 | 纺织、服装、皮毛 | 66,611,810.88 | 0.80 |
| C2 | 木材、家具 | - | - |
| C3 | 造纸、印刷 | 3,689,670.13 | 0.04 |
| C4 | 石油、化学、塑胶、塑料 | 268,996,232.07 | 3.22 |
| C5 | 电子 | 194,623,031.35 | 2.33 |
| C6 | 金属、非金属 | 563,802,407.66 | 6.74 |
| C7 | 机械、设备、仪表 | 937,013,537.58 | 11.21 |
| C8 | 医药、生物制品 | 260,656,713.44 | 3.12 |
| C99 | 其他制造业 | 31,775,990.07 | 0.38 |
| D | 电力、煤气及水的生产和供应业 | 54,016,127.42 | 0.65 |
| E | 建筑业 | 313,204,660.53 | 3.75 |
| F | 交通运输、仓储业 | 214,344,472.10 | 2.56 |
| G | 信息技术业 | 228,572,472.11 | 2.73 |
| H | 批发和零售贸易 | 363,229,353.55 | 4.34 |
| I | 金融、保险业 | 1,671,075,703.51 | 19.99 |
| J | 房地产业 | 415,880,767.17 | 4.97 |
| K | 社会服务业 | 60,645,667.68 | 0.73 |
| L | 传播与文化产业 | 25,231,211.50 | 0.30 |
| M | 综合类 | 160,868,081.52 | 1.92 |
| | 合计 | 6,503,921,069.35 | 77.79 |

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。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 600036 | 招商银行 | 22,770,698 | 411,011,098.90 | 4.92 |
| 2 | 601166 | 兴业银行 | 8,701,703 | 350,765,647.93 | 4.20 |
| 3 | 600104 | 上海汽车 | 12,600,771 | 329,258,146.23 | 3.94 |
| 4 | 601318 | 中国平安 | 4,936,016 | 271,925,121.44 | 3.25 |
| 5 | 000651 | 格力电器 | 7,828,870 | 226,567,497.80 | 2.71 |
| 6 | 601628 | 中国人寿 | 6,232,710 | 197,514,579.90 | 2.36 |
| 7 | 600019 | 宝钢股份 | 20,279,877 | 195,903,611.82 | 2.34 |
| 8 | 600491 | 龙元建设 | 10,311,407 | 180,965,192.85 | 2.16 |
| 9 | 600178 | 东安动力 | 9,434,795 | 158,598,903.95 | 1.90 |
| 10 | 600383 | 金地集团 | 10,500,000 | 145,740,000.00 | 1.74 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 国家债券 | 19,991,406.60 | 0.24 |
| 2 | 央行票据 | 393,180,000.00 | 4.70 |
| 3 | 金融债券 | 598,649,000.00 | 7.16 |
| | 其中:政策性金融债 | 598,649,000.00 | 7.16 |
| 4 | 企业债券 | 687,624,131.70 | 8.22 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 可转债 | 12,223,525.44 | 0.15 |
| 7 | 其他 | - | - |
| 8 | 合计 | 1,711,668,063.74 | 20.47 |

5.5 报告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

| 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 | 080216 | 08国开16 | 4,000,000 | 416,360,000.00 | 4.98 |
| 2 | 0901034 | 09央行票据34 | 2,000,000 | 196,600,000.00 | 2.35 |
| 3 | 0901036 | 09央行票据36 | 2,000,000 | 196,580,000.00 | 2.35 |
| 4 | 090223 | 09国开23 | 1,500,000 | 149,880,000.00 | 1.79 |
| 5 | 122013 | 08北辰债 | 764,660 | 82,308,002.40 | 0.98 |

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细
本基金报告期末持有资产支持证券。

5.7 报告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

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。

5.8.2 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。

5.8.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 6,258,731.84 |
| 2 | 应收证券清算款 | 2,814,388.85 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 15,093,862.74 |
| 5 | 应收申购款 | 157,019.91 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 24,324,003.34 |

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 125709 | 唐钢转债 | 8,517,120.24 | 0.10 |
| 2 | 110003 | 新钢转债 | 3,706,405.20 | 0.04 |

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 600383 | 金地集团 | 145,740,000.00 | 1.74 | 非公开股票流通受限 |

### §6 开放式基金份额变动

单位:份

| | |
|---|---|
| 本报告期期初基金份额总额 | 11,462,195,230.32 |
| 本报告期基金总申购份额 | 191,000,656.83 |
| 减:本报告期基金总赎回份额 | 728,015,604.53 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 10,925,180,282.62 |

### §7 备查文件目录

7.1 备查文件目录
1、中国证监会批准工银瑞信精选平衡混合型证券投资基金设立的文件;
2、《工银瑞信精选平衡混合型证券投资基金基金合同》;
3、《工银瑞信精选平衡混合型证券投资基金托管协议》;
4、基金管理人业务资格批件和营业执照;
5、基金托管人业务资格批件和营业执照;
6、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

7.2 存放地点
基金管理人或基金托管人处。

7.3 查阅方式
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。

# 工银瑞信沪深300指数证券投资基金

## 2009 第四季度报告

2009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**
**报告送出日期:2010年01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2010年1月18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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2009年10月1日起至12月31日止。

### §2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 工银沪深300指数 |
| 交易代码 | 481009 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2009年03月05日 |
| 报告期末基金份额总额 | 4,362,372,287.40份 |
| 投资目标 | 采用指数化投资,通过控制基金投资组合相对于标的指数的偏离度,实现对标的指数的有效跟踪,谋求基金资产的长期增值。 |
| 投资策略 | 本基金原则上采取完全复制策略,即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但因特殊情况导致基金无法获得足够数量的股票时,基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合,追求尽可能贴近目标指数的表现。 |
| 业绩比较基准 | 沪深300指数收益率×95%+商业银行税后活期存款利率×5% |
| 风险收益特征 | 本基金属于股票型基金,风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金,跟踪标的指数市场表现,目标为获取市场平均收益,是股票基金中处于中等风险水平的基金产品。 |
| 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

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

| 主要财务指标 | 报告期(2009年10月01日-2009年12月31日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | 90,780,192.49 |
| 2.本期利润 | 698,041,264.59 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.1933 |
| 4.期末基金资产净值 | 5,618,712,247.72 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.288 |

注:(1)上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)所列数据截止到2009年12月31日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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 | 净值增长率① | 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 | 18.06% | 1.68% | 18.03% | 1.67% | 0.03% | 0.01% |

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

注:1、本基金基金合同于2009年3月5日生效,截至报告期末,本基金基金合同生效尚不满一年。
2、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,本基金已完成建仓:投资于股票资产占基金资产的比例为90%-95%,投资于标的指数成分股票、备选成分股票的资产占基金资产的比例不低于80%(因法规限制原因,导致本基金不能投资相关股票,而致使本基金不能达到上述比例的情形除外)。现金、债券资产以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为5%-10%,其中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5%。权证及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

### §4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 樊智 | 本基金的基金经理,工银瑞信上证央企ETF基金的基金经理 | 2009年09月08日 | - | 6 | 中国籍,毕业于天津大学,获博士学位。2003年4月至2005年6月,任职于中信证券股份有限公司研究部,担任高级研究员。2005年7月加入工银瑞信基金管理有限公司市场营销部从事产品开发工作;2005年12月至2009年9月,任职于风险管理部,历任业务主管、风险管理部副总监。2009年9月8日至今,担任工银瑞信沪深300基金和工银瑞信上证央企ETF基金基金经理。 |
| 胡文彪 | 本基金的基金经理,工银瑞信上证央企ETF基金的基金经理 | 2009年03月05日 | - | 8 | 中国籍,毕业于清华大学,获理学硕士学位。2001年7月至2003年10月,任职于国泰君安证券资产管理总部,担任研究员。2003年11月至2004年3月,任职于华林证券资产管理部,担任研究员。2004年4月至2006年7月,任职于海富通基金管理有限公司产品开发部,担任产品经理。2006年7月,加入工银瑞信基金管理有限公司,历任产品开发部高级经理和权益投资部高级经理。基金经理。2009年3月5日至今,担任工银瑞信沪深300基金基金经理。2009年8月26日至今,担任工银瑞信上证央企ETF基金基金经理。 |

4.2 管理人对投资期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 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》、《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

本基金本报告期没有出现异常交易的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

(1)市场展望和投资策略

本基金为指数型基金,基金管理人将继续按照基金合同的要求,坚持指数化投资策略,通过运用定量分析等技术,分析和应对导致基金跟踪误差的因素,继续努力将基金的跟踪误差控制在较低水平。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期末基金份额净值为1.288元。本报告期内,基金份额净值增长率为18.06%,同期业绩比较基准增长率为18.03%,基金超额收益率为0.03%。

### §5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产的比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | 5,336,925,249.60 | 90.65 |
| | 其中:股票 | 5,336,925,249.60 | 90.65 |
| 2 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中:债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 4 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 5 | 银行存款和结算备付金合计 | 499,796,578.75 | 8.49 |
| 6 | 其他资产 | 50,582,519.41 | 0.86 |
| 7 | 合计 | 5,887,304,347.76 | 100.00 |

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。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 指数投资部分

| 代码 | 行业类别 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| A | 农、林、牧、渔业 | 21,567,151.76 | 0.38 |
| B | 采掘业 | 629,879,822.61 | 11.21 |
| C | 制造业 | 1,602,466,077.45 | 28.52 |
| C0 | 食品、饮料 | 213,537,590.54 | 3.80 |
| C1 | 纺织、服装、皮毛 | 27,432,246.40 | 0.49 |
| C2 | 木材、家具 | - | - |
| C3 | 造纸、印刷 | 13,668,545.20 | 0.24 |
| C4 | 石油、化学、塑胶、塑料 | 134,893,741.75 | 2.40 |
| C5 | 电子 | 20,575,575.00 | 0.37 |
| C6 | 金属、非金属 | 486,721,114.74 | 8.66 |
| C7 | 机械、设备、仪表 | 517,831,798.35 | 9.22 |
| C8 | 医药、生物制品 | 163,375,240.12 | 2.91 |
| C99 | 其他制造业 | 24,430,225.35 | 0.43 |
| D | 电力、煤气及水的生产和供应业 | 167,154,118.67 | 2.97 |
| E | 建筑业 | 151,885,889.30 | 2.70 |
| F | 交通运输、仓储业 | 253,577,955.48 | 4.51 |
| G | 信息技术业 | 164,744,773.69 | 2.93 |
| H | 批发和零售贸易 | 165,318,577.75 | 2.94 |
| I | 金融、保险业 | 1,692,958,084.24 | 30.13 |
| J | 房地产业 | 314,583,540.71 | 5.60 |
| K | 社会服务业 | 65,035,028.09 | 1.16 |
| L | 传播与文化产业 | 13,915,071.00 | 0.25 |
| M | 综合类 | 93,839,158.85 | 1.67 |
| | 合计 | 5,336,925,249.60 | 94.98 |

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。

5.2.2 积极投资部分
无。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 期末指数投资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 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 600036 | 招商银行 | 10,615,487 | 191,609,540.35 | 3.41 |
| 2 | 601328 | 交通银行 | 19,355,991 | 180,978,515.85 | 3.22 |
| 3 | 600016 | 民生银行 | 18,953,749 | 149,924,154.59 | 2.67 |
| 4 | 601318 | 中国平安 | 2,684,033 | 147,863,377.97 | 2.63 |
| 5 | 600030 | 中信证券 | 4,337,701 | 137,808,760.77 | 2.45 |
| 6 | 601166 | 兴业银行 | 3,271,135 | 131,859,451.85 | 2.35 |
| 7 | 600000 | 浦发银行 | 4,951,521 | 107,398,490.49 | 1.91 |
| 8 | 601088 | 中国神华 | 3,082,435 | 107,330,386.70 | 1.91 |
| 9 | 000002 | 万 科A | 9,047,017 | 97,798,253.77 | 1.74 |
| 10 | 601169 | 北京银行 | 4,417,262 | 85,429,847.08 | 1.52 |

5.3.2 积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细
无。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
本基金报告期末未持有债券。

5.5 报告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
本基金报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细
本基金报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告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
本基金报告期末未持有权证。

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

5.8.2 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。

5.8.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 864,156.19 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 78,959.14 |
| 5 | 应收申购款 | 49,639,404.08 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 50,582,519.41 |

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期未未持有处于转股期的可转换债券。

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.8.5.1 期末指数投资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。

5.8.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明
无。

### §6 开放式基金份额变动

单位:份

| | |
|---|---|
| 本报告期期初基金份额总额 | 3,317,191,680.67 |
| 本报告期基金总申购份额 | 2,957,572,080.85 |
| 减:本报告期基金总赎回份额 | 1,912,391,474.12 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 4,362,372,287.40 |

### §7 备查文件目录

7.1 备查文件目录
1、中国证监会批准工银瑞信沪深300指数型证券投资基金募集的文件;
2、《工银瑞信沪深300指数型证券投资基金基金合同》;
3、《工银瑞信沪深300指数型证券投资基金托管协议》;
4、基金管理人业务资格批件、营业执照;
5、基金托管人业务资格批件、营业执照;
6、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

7.2 存放地点
备查文件存放于基金管理人或基金托管人处。

7.3 查阅方式
投资者可到基金管理人或基金托管人的办公场所、营业场所及网站免费查阅备查文件。在支付工本费后,投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

# 工银瑞信信用添利债券型证券投资基金

## 2009 第四季度报告

2009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**
**报告送出日期:2010年01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2010年1月18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。

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。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期为2009年10月1日起至12月31日止。

### §2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称: | 工银添利债券 |
| 基金运作方式: | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日: | 2008年04月14日 |
| 报告期末基金份额总额: | 2,896,897,300.34份 |
| 投资目标: | 在控制风险与保持资产流动性的基础上,追求基金资产的长期稳定增值 |
| 投资策略: | 本基金将采取利率策略、信用策略、相对价值策略等积极投资策略,在严格控制风险的前提下,发掘和利用市场失衡提供的投资机会,实现组合增值 |
| 业绩比较基准: | 80%×中债企业债总指数+20%×中债国债总指数 |
| 风险收益特征: | 本基金为债券型基金,属于低风险基金产品,其长期平均风险和预期收益率低于混合型基金,高于货币市场基金 |
| 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 |
| 下属两级基金简称: | 工银添利债券A / 工银添利债券B |
| 下属两级交易代码: | 485107 / 485007 |
| 下属两级基金报告期末份额总额: | 1,670,970,569.60 / 1,225,926,730.74 |

### §3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

| 主要财务指标 | 报告期(2009年10月01日-2009年12月31日) | |
|---|---|---|
| | A类 | B类 |
| 1.本期已实现收益 | 20,289,631.72 | 15,647,793.35 |
| 2.本期利润 | 43,849,664.94 | 35,550,250.02 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0311 | 0.0307 |
| 4.期末基金资产净值 | 1,891,568,092.08 | 1,377,337,479.86 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.1320 | 1.1235 |

注:(1)上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)所列数据截止到2009年12月31日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

分级A

| 阶段 | 净值增长率(1) | 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 | 2.97% | 0.20% | 1.43% | 0.07% | 1.54% | 0.13% |

分级B

| 阶段 | 净值增长率(1) | 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 | 2.86% | 0.20% | 1.43% | 0.07% | 1.43% | 0.13% |

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

注:本基金基金合同于2008年4月14日生效,按基金合同规定,本基金建仓期为6个月。截至报告期末,本基金的各项投资组合比例符合基金合同第十二条(二)投资范围、(七)投资限制中规定的各项比例:本基金投资于债券类资产(含可转换债券)的比例不低于基金资产的80%,本基金持有的公司债券、企业债券、金融债、短期融资券、资产支持证券等除国债、央行票据以外的固定收益类资产投资比例不低于债券类资产的80%,投资于股票等权益类证券的比例不超过基金资产的20%,且必须在权益类资产上市交易或流通受限解除后不超过3个月的时间内卖出,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,投资于可转换债券的比例不超过基金资产净值的30%,法律法规及本基金合同规定的其他投资比例限制。

### §4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 江明波 | 专户投资部固定收益总监,本基金的基金经理 | 2008年04月14日 | - | 9 | 中国籍,毕业于复旦大学,获理学硕士学位。2000年7月至2001年12月,任职于长城证券有限责任公司,担任研究员。2001年12月至2006年12月,任职于鹏华基金管理有限公司,2001年12月至2003年7月担任债券研究员;2003年7月至2003年11月担任基金经理助理;2003年11月26日至2007年1月20日担任普天债券基金经理;2004年6月至2006年12月,担任全国社保基金债券组合和回购组合基金经理;2006年8月至2006年12月担任机构理财部总监助理;2004年6月至2006年12月担任固定收益小组负责人。2008年4月14日至今,担任工银瑞信信用添利基金基金经理。2008年11月至2009年11月,担任专户投资部副总监。2009年11月起,担任专户投资部固定收益总监。 |

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 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》、《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

本基金本报告期没有出现异常交易的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和业