

工银瑞信信用添利债券型证券投资基金

2010 第三季度报告

2010年9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
报告截止日期:2010年10月26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。
基金管理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10月22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。

§2 基金产品概况

Table with 2 columns: 基金名称, 工银瑞信添利债券型证券投资基金; 交易代码, 485107; 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; 报告期末基金资产总额, 5,564,345,240.23元; 投资目标, 在控制风险和保持资产流动性的基础上,追求基金资产的长期稳定增值;

§3 主要财务指标和基金净值表现

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期末(2010年9月30日); 1.本期已实现收益, 48,848,226.41; 2.本期利润, 70,696,955.30; 3.加权平均基金份额本期利润, 0.0256; 4.期末基金资产净值, 3,714,544,132.64; 5.期末基金份额净值, 1.1554; 1.2.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; 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; 3.2.2.自基金合同成立以来基金份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较

§4 投资组合报告

4.1 报告期末基金资产组合情况
4.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
4.3 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

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%); 1.权益投资, 450,461,329.08, 8.10%; 2.固定收益投资, 450,461,329.08, 8.10%; 3.其中:债券, 6,841,163,401.55, 90.44%; 4.其中:中期票据, --, --; 5.其中:银行存款和结算备付金合计, 176,572,327.92, 2.33%; 6.其中:买入返售金融资产, 36,300,181.56, 1.27%; 7.合计, 7,564,497,240.13, 100.00%

§5 报告期末基金前十名股票投资明细

Table with 5 columns: 代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%); 1. 601018 宁波港, 44,727,905, 158,784,062.75, 2.52; 2. 601818 光大银行, 17,043,874, 58,971,804.04, 0.94; 3. 002422 科伦药业, 326,678, 40,102,991.28, 0.64; 4. 601288 农业银行, 14,668,164, 38,505,908.04, 0.62; 5. 601717 郑煤机, 1,116,800, 35,548,034.47, 0.57; 6. 600089 特变电工, 1,301,247, 22,717,822.50, 0.36; 7. 300124 汇川技术, 89,502, 8,414,083.02, 0.13; 8. 002465 海格通信, 181,818, 7,310,901.78, 0.12; 9. 300102 乾照光电, 6,043,869.82, 0.10; 10. 002480 新莱股份, 106,521, 5,744,677.53, 0.09

§6 报告期末基金前十名债券投资明细

Table with 5 columns: 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. 国债, --, --, --, --, --; 2. 央行票据, 730,826,000.00, 11.62; 3. 金融债, 1,734,164,000.00, 27.57; 4. 企业债, 3,435,812,602.35, 54.63; 5. 企业短期融资券, 30,186,000.00, 0.48; 6. 可转债, 910,174,799.20, 14.47; 7. 其他, --, --, --, --, --; 8. 合计, 6,841,163,401.55, 108.78

§7 投资组合报告附注

注:1.本基金合同于2008年4月14日生效,截至报告期末,本基金建仓期为6个月,截至报告期末,本基金的各项投资比例符合基金合同第二条(四)投资组合比例的相关规定;
注:2.本基金合同于2008年4月14日生效,截至报告期末,本基金建仓期为6个月,截至报告期末,本基金的各项投资比例符合基金合同第二条(四)投资组合比例的相关规定;

§8 投资组合报告附注

注:1.本基金合同于2008年4月14日生效,截至报告期末,本基金建仓期为6个月,截至报告期末,本基金的各项投资比例符合基金合同第二条(四)投资组合比例的相关规定;

§9 投资组合报告附注

注:1.本基金合同于2008年4月14日生效,截至报告期末,本基金建仓期为6个月,截至报告期末,本基金的各项投资比例符合基金合同第二条(四)投资组合比例的相关规定;

§10 投资组合报告附注

注:1.本基金合同于2008年4月14日生效,截至报告期末,本基金建仓期为6个月,截至报告期末,本基金的各项投资比例符合基金合同第二条(四)投资组合比例的相关规定;

§11 投资组合报告附注

注:1.本基金合同于2008年4月14日生效,截至报告期末,本基金建仓期为6个月,截至报告期末,本基金的各项投资比例符合基金合同第二条(四)投资组合比例的相关规定;

§12 投资组合报告附注

注:1.本基金合同于2008年4月14日生效,截至报告期末,本基金建仓期为6个月,截至报告期末,本基金的各项投资比例符合基金合同第二条(四)投资组合比例的相关规定;

§13 投资组合报告附注

注:1.本基金合同于2008年4月14日生效,截至报告期末,本基金建仓期为6个月,截至报告期末,本基金的各项投资比例符合基金合同第二条(四)投资组合比例的相关规定;

§14 投资组合报告附注

注:1.本基金合同于2008年4月14日生效,截至报告期末,本基金建仓期为6个月,截至报告期末,本基金的各项投资比例符合基金合同第二条(四)投资组合比例的相关规定;

§15 投资组合报告附注

注:1.本基金合同于2008年4月14日生效,截至报告期末,本基金建仓期为6个月,截至报告期末,本基金的各项投资比例符合基金合同第二条(四)投资组合比例的相关规定;

§16 投资组合报告附注

注:1.本基金合同于2008年4月14日生效,截至报告期末,本基金建仓期为6个月,截至报告期末,本基金的各项投资比例符合基金合同第二条(四)投资组合比例的相关规定;

§17 投资组合报告附注

注:1.本基金合同于2008年4月14日生效,截至报告期末,本基金建仓期为6个月,截至报告期末,本基金的各项投资比例符合基金合同第二条(四)投资组合比例的相关规定;

§18 投资组合报告附注

注:1.本基金合同于2008年4月14日生效,截至报告期末,本基金建仓期为6个月,截至报告期末,本基金的各项投资比例符合基金合同第二条(四)投资组合比例的相关规定;

§19 投资组合报告附注

注:1.本基金合同于2008年4月14日生效,截至报告期末,本基金建仓期为6个月,截至报告期末,本基金的各项投资比例符合基金合同第二条(四)投资组合比例的相关规定;

§20 投资组合报告附注

注:1.本基金合同于2008年4月14日生效,截至报告期末,本基金建仓期为6个月,截至报告期末,本基金的各项投资比例符合基金合同第二条(四)投资组合比例的相关规定;

§21 投资组合报告附注

注:1.本基金合同于2008年4月14日生效,截至报告期末,本基金建仓期为6个月,截至报告期末,本基金的各项投资比例符合基金合同第二条(四)投资组合比例的相关规定;

§22 投资组合报告附注

注:1.本基金合同于2008年4月14日生效,截至报告期末,本基金建仓期为6个月,截至报告期末,本基金的各项投资比例符合基金合同第二条(四)投资组合比例的相关规定;

§23 投资组合报告附注

注:1.本基金合同于2008年4月14日生效,截至报告期末,本基金建仓期为6个月,截至报告期末,本基金的各项投资比例符合基金合同第二条(四)投资组合比例的相关规定;

§24 投资组合报告附注

注:1.本基金合同于2008年4月14日生效,截至报告期末,本基金建仓期为6个月,截至报告期末,本基金的各项投资比例符合基金合同第二条(四)投资组合比例的相关规定;

§25 投资组合报告附注

注:1.本基金合同于2008年4月14日生效,截至报告期末,本基金建仓期为6个月,截至报告期末,本基金的各项投资比例符合基金合同第二条(四)投资组合比例的相关规定;

§26 投资组合报告附注

注:1.本基金合同于2008年4月14日生效,截至报告期末,本基金建仓期为6个月,截至报告期末,本基金的各项投资比例符合基金合同第二条(四)投资组合比例的相关规定;

§27 投资组合报告附注

注:1.本基金合同于2008年4月14日生效,截至报告期末,本基金建仓期为6个月,截至报告期末,本基金的各项投资比例符合基金合同第二条(四)投资组合比例的相关规定;

§28 投资组合报告附注

注:1.本基金合同于2008年4月14日生效,截至报告期末,本基金建仓期为6个月,截至报告期末,本基金的各项投资比例符合基金合同第二条(四)投资组合比例的相关规定;

§29 投资组合报告附注

注:1.本基金合同于2008年4月14日生效,截至报告期末,本基金建仓期为6个月,截至报告期末,本基金的各项投资比例符合基金合同第二条(四)投资组合比例的相关规定;

§30 投资组合报告附注

注:1.本基金合同于2008年4月14日生效,截至报告期末,本基金建仓期为6个月,截至报告期末,本基金的各项投资比例符合基金合同第二条(四)投资组合比例的相关规定;

§31 投资组合报告附注

注:1.本基金合同于2008年4月14日生效,截至报告期末,本基金建仓期为6个月,截至报告期末,本基金的各项投资比例符合基金合同第二条(四)投资组合比例的相关规定;

§32 投资组合报告附注

注:1.本基金合同于2008年4月14日生效,截至报告期末,本基金建仓期为6个月,截至报告期末,本基金的各项投资比例符合基金合同第二条(四)投资组合比例的相关规定;

§33 投资组合报告附注

注:1.本基金合同于2008年4月14日生效,截至报告期末,本基金建仓期为6个月,截至报告期末,本基金的各项投资比例符合基金合同第二条(四)投资组合比例的相关规定;

§34 投资组合报告附注

注:1.本基金合同于2008年4月14日生效,截至报告期末,本基金建仓期为6个月,截至报告期末,本基金的各项投资比例符合基金合同第二条(四)投资组合比例的相关规定;

§35 投资组合报告附注

注:1.本基金合同于2008年4月14日生效,截至报告期末,本基金建仓期为6个月,截至报告期末,本基金的各项投资比例符合基金合同第二条(四)投资组合比例的相关规定;

§36 投资组合报告附注

注:1.本基金合同于2008年4月14日生效,截至报告期末,本基金建仓期为6个月,截至报告期末,本基金的各项投资比例符合基金合同第二条(四)投资组合比例的相关规定;

§37 投资组合报告附注

注:1.本基金合同于2008年4月14日生效,截至报告期末,本基金建仓期为6个月,截至报告期末,本基金的各项投资比例符合基金合同第二条(四)投资组合比例的相关规定;

§38 投资组合报告附注

注:1.本基金合同于2008年4月14日生效,截至报告期末,本基金建仓期为6个月,截至报告期末,本基金的各项投资比例符合基金合同第二条(四)投资组合比例的相关规定;

§39 投资组合报告附注

注:1.本基金合同于2008年4月14日生效,截至报告期末,本基金建仓期为6个月,截至报告期末,本基金的各项投资比例符合基金合同第二条(四)投资组合比例的相关规定;

§40 投资组合报告附注

注:1.本基金合同于2008年4月14日生效,截至报告期末,本基金建仓期为6个月,截至报告期末,本基金的各项投资比例符合基金合同第二条(四)投资组合比例的相关规定;

§41 投资组合报告附注

注:1.本基金合同于2008年4月14日生效,截至报告期末,本基金建仓期为6个月,截至报告期末,本基金的各项投资比例符合基金合同第二条(四)投资组合比例的相关规定;

§42 投资组合报告附注

注:1.本基金合同于2008年4月14日生效,截至报告期末,本基金建仓期为6个月,截至报告期末,本基金的各项投资比例符合基金合同第二条(四)投资组合比例的相关规定;

§43 投资组合报告附注

注:1.本基金合同于2008年4月14日生效,截至报告期末,本基金建仓期为6个月,截至报告期末,本基金的各项投资比例符合基金合同第二条(四)投资组合比例的相关规定;

§44 投资组合报告附注

注:1.本基金合同于2008年4月14日生效,截至报告期末,本基金建仓期为6个月,截至报告期末,本基金的各项投资比例符合基金合同第二条(四)投资组合比例的相关规定;

§45 投资组合报告附注

注:1.本基金合同于2008年4月14日生效,截至报告期末,本基金建仓期为6个月,截至报告期末,本基金的各项投资比例符合基金合同第二条(四)投资组合比例的相关规定;

§46 投资组合报告附注

注:1.本基金合同于2008年4月14日生效,截至报告期末,本基金建仓期为6个月,截至报告期末,本基金的各项投资比例符合基金合同第二条(四)投资组合比例的相关规定;

§47 投资组合报告附注

注:1.本基金合同于2008年4月14日生效,截至报告期末,本基金建仓期为6个月,截至报告期末,本基金的各项投资比例符合基金合同第二条(四)投资组合比例的相关规定;

§48 投资组合报告附注

注:1.本基金合同于2008年4月14日生效,截至报告期末,本基金建仓期为6个月,截至报告期末,本基金的各项投资比例符合基金合同第二条(四)投资组合比例的相关规定;

§49 投资组合报告附注

注:1.本基金合同于2008年4月14日生效,截至报告期末,本基金建仓期为6个月,截至报告期末,本基金的各项投资比例符合基金合同第二条(四)投资组合比例的相关规定;

§50 投资组合报告附注

注:1.本基金合同于2008年4月14日生效,截至报告期末,本基金建仓期为6个月,截至报告期末,本基金的各项投资比例符合基金合同第二条(四)投资组合比例的相关规定;

§51 投资组合报告附注

注:1.本基金合同于2008年4月14日生效,截至报告期末,本基金建仓期为6个月,截至报告期末,本基金的各项投资比例符合基金合同第二条(四)投资组合比例的相关规定;

§52 投资组合报告附注

注:1.本基金合同于2008年4月14日生效,截至报告期末,本基金建仓期为6个月,截至报告期末,本基金的各项投资比例符合基金合同第二条(四)投资组合比例的相关规定;

§53 投资组合报告附注

注:1.本基金合同于2008年4月14日生效,截至报告期末,本基金建仓期为6个月,截至报告期末,本基金的各项投资比例符合基金合同第二条(四)投资组合比例的相关规定;

§54 投资组合报告附注

注:1.本基金合同于2008年4月14日生效,截至报告期末,本基金建仓期为6个月,截至报告期末,本基金的各项投资比例符合基金合同第二条(四)投资组合比例的相关规定;

§55 投资组合报告附注

注:1.本基金合同于2008年4月14日生效,截至报告期末,本基金建仓期为6个月,截至报告期末,本基金的各项投资比例符合基金合同第二条(四)投资组合比例的相关规定;

§56 投资组合报告附注

注:1.本基金合同于2008年4月14日生效,截至报告期末,本基金建仓期为6个月,截至报告期末,本基金的各项投资比例符合基金合同第二条(四)投资组合比例的相关规定;

§57 投资组合报告附注

注:1.本基金合同于2008年4月14日生效,截至报告期末,本基金建仓期为6个月,截至报告期末,本基金的各项投资比例符合基金合同第二条(四)投资组合比例的相关规定;

工银瑞信中小盘成长股票型证券投资基金

2010 第三季度报告

2010年9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
报告截止日期:2010年10月26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。
基金管理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10月22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。

§2 基金产品概况

Table with 2 columns: 基金名称, 工银瑞信中小盘成长股票型证券投资基金; 交易代码, 481010; 基金运作方式, 契约型开放式; 基金合同生效日, 2010年2月10日; 报告期末基金资产总额, 1,974,424,368.78元; 投资目标, 通过投资高成长性的中小盘股票,追求基金资产长期稳定的增值和收益,在有效控制风险的前提下,力争实现超越基金业绩基准的超额收益;

§3 主要财务指标和基金净值表现

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期末(2010年9月30日); 1.本期已实现收益, -36,660,147.27; 2.本期利润, 328,134,438.26; 3.加权平均基金份额本期利润, 0.1093; 4.期末基金资产净值, 1,999,109,039.23; 5.期末基金份额净值, 1.013; 1.2.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; 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; 3.2.2.自基金合同成立以来基金份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较

§4 投资组合报告

注:1.本基金合同于2010年2月10日生效,截至报告期末,本基金建仓期尚未满一年。

注:2.本基金合同于2010年2月10日生效,截至报告期末,本基金建仓期尚未满一年。

注:3.本基金合同于2010年2月10日生效,截至报告期末,本基金建仓期尚未满一年。

注:4.本基金合同于2010年2月10日生效,截至报告期末,本基金建仓期尚未满一年。

注:5.本基金合同于2010年2月10日生效,截至报告期末,本基金建仓期尚未满一年。

注:6.本基金合同于2010年2月10日生效,截至报告期末,本基金建仓期尚未满一年。

注:7.本基金合同于2010年2月10日生效,截至报告期末,本基金建仓期尚未满一年。

注:8.本基金合同于2010年2月10日生效,截至报告期末,本基金建仓期尚未满一年。

注:9.本基金合同于2010年2月10日生效,截至报告期末,本基金建仓期尚未满一年。

注:10.本基金合同于2010年2月10日生效,截至报告期末,本基金建仓期尚未满一年。

注:11.本基金合同于2010年2月10日生效,截至报告期末,本基金建仓期尚未满一年。

注:12.本基金合同于2010年2月10日生效,截至报告期末,本基金建仓期尚未满一年。

注:13.本基金合同于2010年2月10日生效,截至报告期末,本基金建仓期尚未满一年。

注:14.本基金合同于2010年2月10日生效,截至报告期末,本基金建仓期尚未满一年。

注:15.本基金合同于2010年2月10日生效,截至报告期末,本基金建仓期尚未满一年。

注:16.本基金合同于2010年2月10日生效,截至报告期末,本基金建仓期尚未满一年。

注:17.本基金合同于2010年2月10日生效,截至报告期末,本基金建仓期尚未满一年。

注:18.本基金合同于2010年2月10日生效,截至报告期末,本基金建仓期尚未满一年。

注:19.本基金合同于2010年2月10日生效,截至报告期末,本基金建仓期尚未满一年。

注:20.本基金合同于2010年2月10日生效,截至报告期末,本基金建仓期尚未满一年。

注:21.本基金合同于2010年2月10日生效,截至报告期末,本基金建仓期尚未满一年。

注:22.本基金合同于2010年2月10日生效,截至报告期末,本基金建仓期尚未满一年。

注:23.本基金合同于2010年2月10日生效,截至报告期末,本基金建仓期尚未满一年。

注:24.本基金合同于2010年2月10日生效,截至报告期末,本基金建仓期尚未满一年。

注:25.本基金合同于2010年2月10日生效,截至报告期末,本基金建仓期尚未满一年。

注:26.本基金合同于2010年2月10日生效,截至报告期末,本基金建仓期尚未满一年。

注:27.本基金合同于2010年2月10日生效,截至报告期末,本基金建仓期尚未满一年。

注:28.本基金合同于2010年2月10日生效,截至报告期末,本基金建仓期尚未满一年。

注:29.本基金合同于2010年2月10日生效,截至报告期末,本基金建仓期尚未满一年。

注:30.本基金合同于2010年2月10日生效,截至报告期末,本基金建仓期尚未满一年。

注:31.本基金合同于2010年2月10日生效,截至报告期末,本基金建仓期尚未满一年。

注:32.本基金合同于2010年2月10日生效,截至报告期末,本基金建仓期尚未满一年。

注:33.本基金合同于2010年2月10日生效,截至报告期末,本基金建仓期尚未满一年。

注:34.本基金合同于2010年2月10日生效,截至报告期末,本基金建仓期尚未满一年。

注:35.本基金合同于2010年2月10日生效,截至报告期末,本基金建仓期尚未满一年。

注:36.本基金合同于2010年2月10日生效,截至报告期末,本基金建仓期尚未满一年。

注:37.本基金合同于2010年2月10日生效,截至报告期末,本基金建仓期尚未满一年。

注:38.本基金合同于2010年2月10日生效,截至报告期末,本基金建仓期尚未满一年。

注:39.本基金合同于2010年2月10日生效,截至报告期末,本基金建仓期尚未满一年。

注:40.本基金合同于2010年2月10日生效,截至报告期末,本基金建仓期尚未满一年。

注:41.本基金合同于2010年2月10日生效,截至报告期末,本基金建仓期尚未满一年。

注:42.本基金合同于2010年2月10日生效,截至报告期末,本基金建仓期尚未满一年。

注:43.本基金合同于2010年2月10日生效,截至报告期末,本基金建仓期尚未满一年。

注:44.本基金合同于2010年2月10日生效,截至报告期末,本基金建仓期尚未满一年。

注:45.本基金合同于2010年2月10日生效,截至报告期末,本基金建仓期尚未满一年。