上证中央企业50交易型开放式指数证券投资基金2010年年度报告摘要

基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司 基金托管人:招商银行股份有限公司送出日期:二〇一一年三月二十六日

\$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在带的法律责任。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。 基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2011年3月18日 互接水工业局平金大四层,并出现平式企及。基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2011年3月18日 互接水工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、投资组合报告寄内客、保证复核内客不存在废配记载、误导性除述或者重大遗漏。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赛说明书及其更

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文

本报告期目 2010 年 1 月 1 日起至 12	月31日止。
	§2 基金简介
2.1 基金基本情况	
基金简称	工银上证央企 ETF
基金主代码	510060
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2009年8月26日
基金管理人	工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	810,959,219.00 🛱
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所

紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化,实现与 标的指数表现相一致的长期投资收益。 本基金主要采取完全复制策略,跟踪标的指数的表现,即按照标指数的成份股票的构成及其权重构建基金股票投资组合,并根据的指数成份股票及其权重构建基金股票投资组合,并根据处金数量分量。 本基金可以选择其它证券或证券组合对标的指数中的股票加以 设策略 V险收益特征

2.3 基金管理人和基金托管 0755-83199084 yan_zhang@cmbchina.com

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

登载基金年度报告正文的管理人互联网网块

		金额早位:人民巾
3.1.1 期间数据和指标	2010年	2009年8月26日-2009年12月31日
本期已实现收益	-310,706,452.23	210,880,856.61
本期利润	-486,984,349.83	305,985,845.97
加权平均基金份额本期利润	-0.4427	0.1190
本期基金份额净值增长率	-23.37%	10.40%
3.1.2 期末数据和指标	2010 年末	2009 年末
期末可供分配基金份额利润	-0.2408	0.1408
期末基金资产净值	1,072,589,599.17	2,733,300,386.83
期末基金份额净值	1.3226	1.7260

在:1.7月还需要犯项制的外下包括对相人以明规文的需要的各项权用。11人政用由当时收益从于安顷 1 月79级 于; 2.本期已实现收益是指数金期利息收入投资收益、其他收入 怀含公允价值变对收益 加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对收益;

3、本基金基金合同生效日为 2009 年 8 月 26 日

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

J.2.1 (2) 100	SELECTION OF THE REAL PROPERTY CONTRACTOR OF THE PROPERTY OF T						
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	4.40%	1.70%	4.49%	1.74%	-0.09%	-0.04%	
过去六个月	8.53%	1.46%	8.40%	1.50%	0.13%	-0.04%	
过去一年	-23.37%	1.49%	-22.84%	1.52%	-0.53%	-0.03%	
自基金合同生效 起至今	-15.40%	1.51%	-14.04%	1.64%	-1.36%	-0.13%	
** ***********************************							

注:本基金基金合同于2009年8月26日生效。按基金合同规定,本基金建仓期不超过3个月。截至报告期末,本基金各 项投资符合基金合同的规定:本基金主要投资于标的指数成份股票、备选成份股票、一级市场新发股票、债券、权证以及中国 证监会介许基金投资的其他金融工具。其中,基金投资干标的指数成份股票及各选成份股票的比例不低于基金资产净值的

3.2.3 自基金合同生效以来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

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 其他指标

本基金自基金合同生效日 2009 年 8 月 26 日至 2010 年末均未实施利润分配。 §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

4.1.1 金並田軍人及共同理查認的近空 本基金管理人为工報網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 台资基金管理公司,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

截至 2010年12月31日,公司旗下管理16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、 工银端信席还平衡混合型基金。工银端信题地或长股票基金。工银端信增强收益债券型基金、工银端信有企业。工银端信息中国协会全规定置股票型基金、工银端信息用水价券型基金、工银端信息用水价券型基金、工银端信由用协会全规定置股票型基金、工银端信言用来利债券型基金、工银端信金、重要工程、工银油信金、建筑基金、上银油信金、建筑基金、上银油信金、建筑基金、工银油信金、建筑基金、工银油信金、建筑基金、工银油信金、建筑基金、工银油信金、建筑基金、工银油信金、建筑工作。 利 ETF 联接基金,证券投资基金管理规模达 579 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

姓名	职务	任本基金的基金	经理 (助理)期限	证券从业	说明
姓名 非	RF.93	任职日期	离任日期	年限	150.97
樊智	本基金理(清) 本	2009年9月8日	-	7	中国縣、毕业于天津大学、获土学位、2003年4月至20年6月,任职于中信证券股有限公司市场家,担任高级交易、2005年7月加入工银信基金管理保险公司市场产品开发工作;200512月至2009年9月,任职、经营理部局、51至6个3月,10至6年2月,2010年1月5日至今,担任工银增信产业产于基金基金经理。2010年1月5日至今,担任工银增信营业产工,发展企业企业,2010年11月东县全基金经理。2010年11月东县全基金经理。2010年11月东县全基金经理。2010年11月东县全基金经理。2010年11月东县全基金经理。2010年11月东县全基金经理。2010年11月东县全基金经理。2010年11月东县全基金经理。2010年11月东县全基金经理。2010年11月东县全基金经理。2010年11月东县全基金金经理。2010年11月下联
朝文彪	本基金型的基工 金型;汽车的基工 300 基金型偏全 基金型偏全 工工盘 基金型 基金经 基金经 基金的	2009年8月26日	-	9	中国籍、毕业于清华大学、获学硕士学位、2001年7月2003年10月、任职于国奉安证等资产型总部、担任下贸是2003年51月7年2004年3月、任职于第一次,1月至2006年7月。任职于治湖港金管理有限公司产品开销。1月任产品开发部高级经理基金经理。2009年8月,加入工银瑞信基金经理。2009年8月5日今,担任工银瑞信产证。6年2009年8月5日至今,担任工银瑞信产证。6年2009年8月5日至今,担任工银瑞信产证。6年2009年8月5日至今,担任工银瑞信产证。6年2009年8月5日至今,担任工银瑞信产证。6年2009年8月5日至今,担任工银瑞信产证。6年2009年8月5日至今,担任工银瑞信产证。6年2009年8月6日至今,担任工银瑞信产证,6年2009年8月6日至6日至6日至6日至6日至6日至6日至6日至6日至6日至6日至6日至6日至6

樊智的任职日期为公司执委会决议日期

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。

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

6進代刊入刊起刊刊分。4.3. 管理人对报告期内公平交易情况的专项说用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《征券 投资基金法》、概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 这只感激点点,感染自主之中怀止的"烈"自建亚尔加克沙尼尔。他为发展整理与这人工作文的现代目标是见于拉尔特 规矩几当间南阳度,形定了《光平交易管理办法》,曾常交易管理办法,对公司管理的各类资产的公平对待被了消确具体的 规定,并规定对实验是票,债券时候的价格和市场价格差距较大,可能存在继续股价,利益输送等违法主规情况进行监控。本 报告期,按照时间优先、价格优长的原则,本公司对满足银份条件且对同一证券有相同交易需求的竞选金等投资组合。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。

432 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 4.3.3 异常交易行为的专项说明 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的

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

本报告期内,本基金跟踪标的指数的日均偏离度为0.09%,偏离度年化标准差为2.00%。本基金跟踪误差产生的主要来

2010年,本基金份额净值增长率为 -23.37%,比较基准收益率为 -22.84%

4.5 管理人对弦观经济、证券市场及行业走势的高要限望 本基金为指数型基金、基金管理、并继续按照基金合同约要求,坚持指数化投资策略,通过运用定量分析等技术、分析 应对导致基金则器现接的因素。继续努力将基金的跟踪误差控制在较低水平。 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

4.6.1 参与估值流程各方及人员(成小组)的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历

(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

4.6.1.2 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品组成。

7.944年7月7年7月7日 (1987年) (19874年) (1987年) (1987年) (1987年) (1987年) (1987年) (1987年) (1987年) (1987

4.6.4 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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 本报告期内,本基金未满足基金合同中关于收益分配的条件,未实施利润分配。

\$5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 托管人声明 左★407年904

5.1 核市纳州平盛盛江自入建规宁自由区型约 托管人即其。在报告期内、基金托管人——报商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,严格 行了 律华人民共和国证券投资基金注及其他有关法律法规、基金合同、完全尽职尽贵地履行了应尽的义务。 52 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 本报告期内基金管理人在投资运作。基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申取赎回价格的计算、基金费用开支等

问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规,在各

型要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。 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 本年度报告中财务指标,净值表现,财务会计报告,利润分配,投资组合报告等内容真实,准确和完整,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 审计报告

本年度报告被出具了无保留意见的审计报告,且在审计报告中无强调事项,投资者欲了解详细内容,可阅读年度报告正

会计主体:上证中央企业50交易型开放式指数证券投资基金

		-1-40-t-	单位:人民
资产	附注号	本期末 2010年 12 月 31 日	上年度末 2009年 12 月 31 日
资产:			
银行存款		10,077,798.93	26,319,173.7
结算备付金		665,004.81	1,103,314.3
存出保证金		-	
交易性金融资产		1,064,611,955.54	2,716,702,522.5
其中:股票投资		1,064,611,955.54	2,716,702,522.5
基金投资		-	
债券投资		_	
资产支持证券投资		_	
衍生金融资产		_	
买人返售金融资产		_	
应收证券清算款		_	
应收利息		2,578.59	4,379.
应收股利		_	
应收申购款		_	
递延所得税资产		_	
其他资产		_	
资产总计		1,075,357,337.87	2,744,129,390.
负债和所有者权益	附注号	本期末 2010年 12 月 31 日	上年度末 2009年12月31日
负债:		2010 12 /1 31	2007 1271 31 -
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		368,157.14	5,863,597.
应付赎回款		300,137.14	3,003,377.
应付管理人报酬		489,763.40	928,141.
应付托管费		97,952.67	185,628.
应付销售服务费		91,932.01	103,020.
应付交易费用 应付交易费用		1 421 222 00	2 (75 040
应 位 交 税 費		1,421,233.98	2,675,040.
		_	
应付利息		_	
应付利润		-	
递延所得税负债		-	
其他负债	1	390,631.51	1,176,594
负债合计		2,767,738.70	10,829,003
所有者权益:			
实收基金		1,267,845,569.52	2,476,346,073
未分配利润		-195,255,970.35	256,954,312.
所有者权益合计		1,072,589,599.17	2,733,300,386.
负债和所有者权益总计		1,075,357,337.87	2,744,129,390.

2、基金合同生效日为 2009 年 8 月 26 日。

7.2 利润表会计主体:上证中央企业 50 交易型开放式指数证券投资基金 本报告期:2010年1月1日至2010年12月31日

项目	附注号	本期 2010年1月1日至2010年12 月31日	单位:人民币 上年度可比期间 2009年8月26日至2009年 12月31日
一、收入		-475,774,877.63	318,567,665.21
1利息收入		128,360.91	2,028,925,15
其中:存款利息收入		128,360.91	2,028,925.15
债券利息收入		_	_
资产支持证券利息收人		_	
买人返售金融资产收人		-	
其他利息收入		-	
2.投资收益(损失以""填列)		-298,754,087.21	221,143,975.60
其中:股票投资收益		-322,843,887.19	216,111,049.36
基金投资收益		-	
债券投资收益		-	
资产支持证券投资收益		-	
衍生工具收益		-	
股利收益		24,089,799.98	5,032,926.24
3.公允价值变动收益 假失以 ""号填 列)		-176,277,897.60	95,104,989.36
4. 汇兑收益 假失以"="号填列)		-	-
5.其他收入 假失以 ""号填列)		-871,253.73	289,775.10
减:二、费用		11,209,472.20	12,581,819.24
1.管理人报酬	7.4.8.2.1	7,860,392.59	5,992,048.66
2.托管费	7.4.8.2.2	1,572,078.49	1,198,409.71
3.销售服务费		-	-
4.交易费用		1,324,316.10	5,206,106.36
5.利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用		452,685.02	185,254.51
三、利润总额		-486,984,349.83	305,985,845.97
减:所得税费用		-	-
四、净利润(争亏损以""号填列)		-486,984,349.83	305,985,845.97

			单位:人民币
项目	2010年 1	本期 月1日至2010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)	2,476,346,073.88	256,954,312.95	2,733,300,386.83
二、本期经营活动产生的基金 净值变动数 (本期利润)	-	-486,984,349.83	-486,984,349.83
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)	-1,208,500,504.36	34,774,066.53	-1,173,726,437.83
其中:1.基金申购款	4,039,799,875.62	-187,416,957.98	3,852,382,917.64
2.基金赎回款	-5,248,300,379.98	222,191,024.51	-5,026,109,355.47
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)	1,267,845,569.52	-195,255,970.35	1,072,589,599.17
项目	2009年8	上年度可比期间 月 26 日至 2009 年 12 月 31 日	1
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 儲金净 值)	4,533,767,374.00	-	4,533,767,374.00
二、本期经营活动产生的基金 净值变动数 (本期利润)	-	305,985,845.97	305,985,845.97
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)	-2,057,421,300.12	-49,031,533.02	-2,106,452,833.14
其中:1.基金申购款	3,944,433,082.42	301,895,977.83	4,246,329,060.25
2.基金赎回款	-6,001,854,382.54	-350,927,510.85	-6,352,781,893.39
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)	2,476,346,073.88	256,954,312.95	2,733,300,386.83

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

基金管理公司负责人 主管会计工作负责人

/4-1 基金基本中InC.
上证中央企业 50 交易型开放式指数证券投资基金(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) 准监基金字 2009 377 号文 关于同意上证中央企业 50 交易型开放式指数证券投资基金募集的批复 混准。 工银端信基金管理有限公司于 2009 年 7月 20 日至 2009 年 8月 20 日向社会公开赛集、募集期结束经安永年明会计师事务所验证并组接安水年明 2009 第2章 6043856。A02 号绘资报告后,向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2009 年 算有限责任公司,基金托管人为招商银行股份有限公司。

本基金股票资产跟踪的标的指数为上证中央企业50指数。本基金主要投资于标的指数成份股票、备选成份股票、一级 市场新发股票,债券,权证以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中,基金投资于标的指数成份股票及备选成份股票的比例不低于基金资产净值的90%,但因法律法规的规定而受限制的情形除外。本基金的业绩比较基准为;上证中央企

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《企业会计准则一基本准则》和 38项具体会计准则、其后颁布的应用 指南、蘇幹以及其他相反與定。 推南、蘇幹以及其他相反與定。依称、企业会计值與力,中国正常的(建筑)。 会制定的、俟于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意识、俟于证券投资基金供方企业会计准则。给值业务及份编 特值计价未定项的通知)。但参投资基金信息披露音型办法,证券投资基金信息披露内容与格式准则第2号 作度报 告的内容与格式》、征券投资基金信息披露海快规则》第3号、侯子担及郑柱注的编制及披露、征券投资基金信息披露 后。 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。

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。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

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 般票)交易印花税税率,由原先的 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 般票)交易印花税税率

是自分企品框。例如前、国家依分志向时先次处,自2008年9月19日起。闽旅出由正方按证券 販票 反动中化优化学 缴纳印花规 定让方军部股,接拿不变; 根据财政部、国家税务总局财税字 2005]103 号文 俟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,哲免征收印花税。

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,

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 [2018] 2 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

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 和收入。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 lb7 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 lb2 号文规定,扣缴义务人在代扣代缴

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

10文字中非流迪股股东迪过对矿万式问流迪斯 7.4.7 关联方关系	z 放
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
招商银行股份有限公司	基金托管人
中国工商银行股份有限公司	基金管理人股东
瑞士信贷	基金管理人股东
山国沅洋沅岭 應閉 道公司	其公等用 L 卧左

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。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金于 2010 年度及 2009 年 8 月 26 日 儘金合同生效日)至 2009 年 12 月 31 日止会计期间均未通过关联方交易单 元进行交易。 7.4.8.2 关联方报酬

		单位:人民币元
项目	本期 2010年1月1日至2010年12月 31日	上年度可比期间 2009年8月26日至2009年12 月31日
当期发生的基金应支付的管理费	7,860,392.59	5,992,048.66
其中:支付给销售机构的客户维护费	-	-

注:1、基金管理费按前一日的基金资产净值的0.50%的年费率计提。计算方法如下:

H 为每日应计提的基金管理费 E 为前一日的基金资产净值

2、基金管理费每日计提,逐日累计至每月月底,按月支付。

7.4.8.2.2 基金托管费

本期 10年1月1日至2010年12月 31日 上年度可比期间 2009年8月26日至2009年12

2、基金托管费每日计提,逐日累计至每月月底,按月支付。

本基金本报告期及 2009 年 8 月 26 日 健金合同生效日)至 2009 年 12 月 31 日止会计期间均未与关联方进行银行间同

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。 7.4.8.4.2 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

				単位:人民市元		
关联方 名称	本期 2010年1月1日至2010年12月31日		上年度可比期间 2009年8月26日至2009年12月31日			
冶称	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入		
银行股份有限公司	10,077,798.93	121,723.79	26,319,173.77	1,993,561.04		
8.6 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。

7.4.9.2 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的股票。

7.4.10 有助于理解和分析会计根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事项 §8 投资组合报告

7.4.9.3 期末债券下回购交易中作为抵押的债券

8.1 期末基金资产组合情况 占基金总资产的比例 (%) 1,064,611,955 4 买人返售金融资

7存款和结算备付金合计 10,742,803. 100.00

8.2.1 指数投资按行业分类的股票投资组合

			Dil (60)
A	农、林、牧、渔业	-	-
В	采掘业	173,489,136.53	16.17
С	制造业	153,253,741.81	14.29
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	47,014,135.74	4.38
C7	机械、设备、仪表	106,239,606.07	9.90
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	55,700,265.07	5.19
E	建筑业	90,215,920.54	8.41
F	交通运输、仓储业	61,851,064.28	5.77
G	信息技术业	32,120,768.70	2.99
Н	批发和零售贸易	9,878,997.00	0.92
I	金融、保险业	467,282,380.11	43.57
J	房地产业	20,819,681.50	1.94
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	1,064,611,955,54	99.26

2、由于四舍五人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。 8.2.2 积极投资按行业分类的股票投资组合 8.3 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所有股票投资明细

8.3.1 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

77,981,905.9 2,334,160 57,677,093.6 51,294,969.5 6,003,882

2,659,762

8.3.2 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

				金额单位:人民市
序号	股票代码	股票名称	本期累计买人金额	占期初基金资产净值 比例 %)
1	601988	中国银行	96,815,523.37	3.54
2	601998	中信银行	72,331,562.72	2.65
3	600900	长江电力	40,757,196.03	1.49
4	601668	中国建筑	36,859,017.47	1.35
5	601939	建设银行	20,022,270.92	0.73
6	601328	交通银行	19,175,993.66	0.70
7	600030	中信证券	19,016,725.09	0.70
8	601618	中国中治	17,555,222.90	0.64
9	601299	中国北车	15,176,482.23	0.56
10	600999	招商证券	13,471,376.49	0.49
11	600048	保利地产	12,747,639.72	0.47
12	601989	中国重工	12,508,548.00	0.46
13	601788	光大证券	9,275,917.83	0.34
14	601288	农业银行	8,855,487.71	0.32
15	601600	中国铝业	6,718,192.84	0.25
16	601106	中国一重	5,094,559.12	0.19
17	600115	东方航空	5,059,779.04	0.19
18	601601	中国太保	4,428,522.99	0.16
19	601088	中国神华	4,214,805.92	0.15
20	600029	南方航空	3,785,028.40	0.14

2.买人金额按买人成交金额 钺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

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	601998	中信银行	92,914,790.02	3.40
2	600030	中信证券	41,884,144.80	1.53
3	601628	中国人寿	29,650,475.56	1.08
4	601939	建设银行	28,519,009.65	1.04
5	600048	保利地产	21,143,765.52	0.77
6	601328	交通银行	16,729,352.12	0.61
7	601601	中国太保	16,487,411.92	0.60
8	600011	华能国际	14,521,909.83	0.53
9	601088	中国神华	14,362,286.31	0.53
10	600050	中国联通	8,390,607.38	0.31
11	601857	中国石油	7,535,847.15	0.28
12	600028	中国石化	7,059,744.72	0.26
13	600500	中化国际	6,747,063.21	0.25
14	600019	宝钢股份	6,288,949.56	0.23
15	601872	招商轮船	6,051,191.72	0.22
16	600900	长江电力	5,968,613.72	0.22
17	600528	中铁二局	5,814,272.72	0.21
18	600087	长航油运	5,272,075.06	0.19
19	600428	中远航运	5,114,991.75	0.19
20	600737	中粮屯河	5,081,980.60	0.19

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 843 买人股票的成本总额及卖出股票的收入总额

人股票成本 (成交)总额 463,741,632.18 注:买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额 绒交单价乘以成交数量 减列,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

6.3 纳木双侧分面评分少年的例分类。 基基金本报告期末持着信势。 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 本基金本报告期末持有债券。 8.7 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

8.9.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有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证

8.9.2 基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库

2 应收证券清算款

本基金本报告期末未持有处于强级期的可转换债券。 8.9. 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明 8.9.51. 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明 本基金本报告期末指数投资前十名股票中未存在流通受限情况。 8.9.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中未存在流通受限情况 9.1 期末基金份额持有人广数及持有人结构

持有人户数 机构投资者 持有份额

序号 40,580,100.0 6,999,956.0 4,164,200.0 10 永安财产保险股份有限公司

§10 开放式基金份额变动 1,583,959,219.0 3,357,000,000.00

810,959,219.00

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。 2. 推動信基金管理有限公司第二届董事会第二十三次会议审议、同意戴勇毅先生辞去工银瑞信基金管理有 公司部总经理职务。基金管理人已于2010年5月26日对外披露。 2. 在现场信基金管理机已计2010年5月26日对外披露。 2. 在现场信基金管理机已计2010年5月26日或事本区第二十九次会议审议通过、同意畅到生先生 企公司董事长原务,并选举部编队生组任公司董事长、李晓鹏先生负重事长任职价格已录中国证券监督管理委员 建监计司(2010)1749 与文陵信。基金管理人已于2010年12月8日对外披露上述事项。 2. 基金任意人任意副订、元

告期内应支付给安永华明会计师事务所审计费用玖万元整,该审计机构自基金合同生效日起向本基金提供审计

11.4 基金投资策略的改变 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

备注 佣金 申银万国 132,267,654.1 15.549 112,427.65 15.54%

(1)选择标准:注重综合服务能力

金额单位:人民币元

)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。

37,624.23

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。 · 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

44,263,566.5

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

6 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,

(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

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。 6)诺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。