

工银瑞信精选平衡混合型证券投资基金

2011 第二季度 报告

2011年6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:中国银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一一年七月十九日

\$1 重要提示

基金管理人的董事会及监事会在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、完整性和合规性承担个别及连带责任。

基金经理承诺:中行国证银行成份股有限公司根据基金合同规定,于2011年7月15日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

基金经理承诺:承诺忠实履行勤勉尽责的职责管理运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金经理承诺:在任职期间并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中的投资策略未作申明。

本报告期为2011年4月1日起至2011年6月30日止。

\$2 基金产品概况

基金简称	工银瑞信精选平衡混合
交易代码	430003
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
报告期末基金份额总额	10,360,788,990.93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	本基金将重点围绕研究、遵循系统化、多样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%×中证300指数收益率+40%×恒生巴克莱综合本币指数+货币市场指数收益率
风险收益特征	本基金属于中等偏低风险品种,风险水平介于股票型基金与债券型基金之间。
基金管理人	工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

\$3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标	报告期(2011年4月1日 - 2011年6月30日)
1.本期已实现收益	42,375,206.68
2.本期利润	-136,482,853.09
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0131
4.期末基金份额净值	6,418,386,478.90
5.期末基金份额总额	6,095,333

注:1.上表基本每股收益和加权平均基金份额净值变动率与同期同类比较基准收益率变动的对比表

2.朱斯杰现担任“本基金基金经理,投资人,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;本期期初至报告期末的累计增加金额占本期公允价值变动收益”。

3.所列数据截至2011年6月30日。

4.基金净值的计算方法

5.报告期基金份额净值增长率及其与同期同类比较基准收益率的比较

阶段

净值增长(%)

净值得标(%)

亚银行业基准收益(%)

业绩比较基准收益率(%)

(1)-(3)

(2)-(4)

过去三个月

-2.10%

1.00%

-3.10%

0.66%

1.00%

0.36%

3.2.2 报告期内各项资产占基金资产净值的比例增减变动及其与同期同类比较基准收益率变动的比较

注:本基金于2006年7月13日生效,按报告期末本基金的各项投资比例计算得到基金合同第十二条(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,本基金总资产/基金净资产的比例为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%;法律法规及基金合同规定的其他投资比例限制。

5.4 管理人报告

4.1 基金经理(基金经理小组)简介

任本基金的基金经理

姓名 职务 任期日期 离任日期 说明

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投资经理,2005年1月加入工银瑞信基金管理有限公司,2009年11月11日担任工银瑞信基金管理有限公司基金经理,2009年11月12日至今担任工银瑞信精选平衡混合型证券投资基金基金经理。

陈守红 曾任本基金的基金经理(工银瑞信核心价值股票型基金基金经理) 2010年1月25日 2011年4月13日 14 曾任国泰君安证券有限公司研究员,后就职于国泰君安证券有限公司,2008年1月加入工银瑞信基金管理有限公司,2010年1月25日至2011年4月13日担任工银瑞信精选平衡混合型证券投资基金基金经理。

4.2 管理人对报告期内基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,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,依照规定履行义务,勤勉尽责的履行管理运用基金资产,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的利益行为。

4.3 公平交易制度执行情况

为了公平对待各类型投资人,保护各类型投资人利益,避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违纪行为,公司根据《证券投资基金法》、《基金管理公司内部控制制度指导意见》、《证券投资基金托管业务管理办法》、《证券投资基金销售机构公平交易制度指导意见》等法律法规的规定,制定了《公平交易制度》,并严格遵守。公司定期对旗下所有投资组合的同日反向交易行为进行监控,并按月度对旗下所有投资组合的同日反向交易行为进行分析,确保在操作层面上不存在违反公平交易原则的情况。

4.4 报告期内基金的业绩表现和业报的说明

4.5 管理人对宏观经济的评价

本基金本期评价为“中性”,业报比较基准收益率为-3.10%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场运行趋势的展望

4.7 管理人对本基金运作遵规守信情况的说明

本基金于2006年7月13日生效,按报告期末本基金的各项投资比例计算得到基金合同第十二条(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,本基金总资产/基金净资产的比例为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%;法律法规及基金合同规定的其他投资比例限制。

4.8 管理人对报告期内基金运作遵规守信情况的说明

本基金于2006年7月13日生效,按报告期末本基金的各项投资比例计算得到基金合同第十二条(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,本基金总资产/基金净资产的比例为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%;法律法规及基金合同规定的其他投资比例限制。

4.9 管理人对报告期内基金运作遵规守信情况的说明

本基金于2006年7月13日生效,按报告期末本基金的各项投资比例计算得到基金合同第十二条(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,本基金总资产/基金净资产的比例为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%;法律法规及基金合同规定的其他投资比例限制。

4.10 管理人对报告期内基金运作遵规守信情况的说明

本基金于2006年7月13日生效,按报告期末本基金的各项投资比例计算得到基金合同第十二条(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,本基金总资产/基金净资产的比例为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%;法律法规及基金合同规定的其他投资比例限制。

4.11 管理人对报告期内基金运作遵规守信情况的说明

本基金于2006年7月13日生效,按报告期末本基金的各项投资比例计算得到基金合同第十二条(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,本基金总资产/基金净资产的比例为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%;法律法规及基金合同规定的其他投资比例限制。

4.12 管理人对报告期内基金运作遵规守信情况的说明

本基金于2006年7月13日生效,按报告期末本基金的各项投资比例计算得到基金合同第十二条(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,本基金总资产/基金净资产的比例为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%;法律法规及基金合同规定的其他投资比例限制。

4.13 管理人对报告期内基金运作遵规守信情况的说明

本基金于2006年7月13日生效,按报告期末本基金的各项投资比例计算得到基金合同第十二条(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,本基金总资产/基金净资产的比例为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%;法律法规及基金合同规定的其他投资比例限制。

4.14 管理人对报告期内基金运作遵规守信情况的说明

本基金于2006年7月13日生效,按报告期末本基金的各项投资比例计算得到基金合同第十二条(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,本基金总资产/基金净资产的比例为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%;法律法规及基金合同规定的其他投资比例限制。

4.15 管理人对报告期内基金运作遵规守信情况的说明

本基金于2006年7月13日生效,按报告期末本基金的各项投资比例计算得到基金合同第十二条(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,本基金总资产/基金净资产的比例为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%;法律法规及基金合同规定的其他投资比例限制。

4.16 管理人对报告期内基金运作遵规守信情况的说明

本基金于2006年7月13日生效,按报告期末本基金的各项投资比例计算得到基金合同第十二条(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,本基金总资产/基金净资产的比例为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%;法律法规及基金合同规定的其他投资比例限制。

4.17 管理人对报告期内基金运作遵规守信情况的说明

本基金于2006年7月13日生效,按报告期末本基金的各项投资比例计算得到基金合同第十二条(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,本基金总资产/基金净资产的比例为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%;法律法规及基金合同规定的其他投资比例限制。

4.18 管理人对报告期内基金运作遵规守信情况的说明

本基金于2006年7月13日生效,按报告期末本基金的各项投资比例计算得到基金合同第十二条(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,本基金总资产/基金净资产的比例为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%;法律法规及基金合同规定的其他投资比例限制。

4.19 管理人对报告期内基金运作遵规守信情况的说明

本基金于2006年7月13日生效,按报告期末本基金的各项投资比例计算得到基金合同第十二条(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,本基金总资产/基金净资产的比例为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%;法律法规及基金合同规定的其他投资比例限制。

4.20 管理人对报告期内基金运作遵规守信情况的说明

本基金于2006年7月13日生效,按报告期末本基金的各项投资比例计算得到基金合同第十二条(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,本基金总资产/基金净资产的比例为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%;法律法规及基金合同规定的其他投资比例限制。

4.21 管理人对报告期内基金运作遵规守信情况的说明

本基金于2006年7月13日生效,按报告期末本基金的各项投资比例计算得到基金合同第十二条(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,本基金总资产/基金净资产的比例为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%;法律法规及基金合同规定的其他投资比例限制。

4.22 管理人对报告期内基金运作遵规守信情况的说明

本基金于2006年7月13日生效,按报告期末本基金的各项投资比例计算得到基金合同第十二条(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,本基金总资产/基金净资产的比例为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%;法律法规及基金合同规定的其他投资比例限制。

4.23 管理人对报告期内基金运作遵规守信情况的说明

本基金于2006年7月13日生效,按报告期末本基金的各项投资比例计算得到基金合同第十二条(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,本基金总资产/基金净资产的比例为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%;法律法规及基金合同规定的其他投资比例限制。

4.24 管理人对报告期内基金运作遵规守信情况的说明

本基金于2006年7月13日生效,按报告期末本基金的各项投资比例计算得到基金合同第十二条(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,本基金总资产/基金净资产的比例为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%;法律法规及基金合同规定的其他投资比例限制。

4.25 管理人对报告期内基金运作遵规守信情况的说明

本基金于2006年7月13日生效,按报告期末本基金的各项投资比例计算得到基金合同第十二条(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,本基金总资产/基金净资产的比例为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%;法律法规及基金合同规定的其他投资比例限制。

4.26 管理人对报告期内基金运作遵规守信情况的说明

本基金于2006年7月13日生效,按报告期末本基金的各项投资比例计算得到基金合同第十二条(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,本基金总资产/基金净资产的比例为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%;法律法规及基金合同规定的其他投资比例限制。

4.27 管理人对报告期内基金运作遵规守信情况的说明

本基金于2006年7月13日生效,按报告期末本基金的各项投资比例计算得到基金合同第十二条(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,本基金总资产/基金净资产的比例为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%;法律法规及基金合同规定的其他投资比例限制。

4.28 管理人对报告期内基金运作遵规守信情况的说明

本基金于2006年7月13日生效,按报告期末本基金的各项投资比例计算得到基金合同第十二条(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,本基金总资产/基金净资产的比例为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%;法律法规及基金合同规定的其他投资比例限制。

4.29 管理人对报告期内基金运作遵规守信情况的说明

本基金于2006年7月13日生效,按报告期末本基金的各项投资比例计算得到基金合同第十二条(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,本基金总资产/基金净资产的比例为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%;法律法规及基金合同规定的其他投资比例限制。

4.30 管理人对报告期内基金运作遵规守信情况的说明

本基金于2006年7月13日生效,按报告期末本基金的各项投资比例计算得到基金合同第十二条(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,本基金总资产/基金净资产的比例为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%;法律法规及基金合同规定的其他投资比例限制。

4.31 管理人对报告期内基金运作遵规守信情况的说明

本基金于2006年7月13日生效,按报告期末本基金的各项投资比例计算得到基金合同第十二条(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,本基金总资产/基金净资产的比例为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%;法律法规及基金合同规定的其他投资比例限制。

4.32 管理人对报告期内基金运作遵规守信情况的说明

本基金于2006年7月13日生效,按报告期末本基金的各项投资比例计算得到基金合同第十二条(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,本基金总资产/基金净资产的比例为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